

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 508	Türev Piyasaları	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul

Derse Kabul Koşulları

Dersin Dili Türkçe

Türü Seçmeli

Dersin Düzeyi Yüksek Lisans

Dersin Amacı Ders, öncelikle matlab altyapısı sağlayarak öğrencilerin türev fiyatlama konusunda hesaba dayalı metodları kullanmalarına yardımcı olacaktır.

İçerik Ders, matlab programının kullanımını gerektirdiği için, dersin ilk yarısında programın kullanımı öğretilir. Dersin ikinci yarısında, matlab programı ile desteklenerek türev fiyatlama modeline uygun hesaplama teknikleriyle geçiş yapılır.

Kaynaklar Desmond J. Higham, Nicholas J. Higham MATLAB Guide 2nd Edition SIAM: Society for Industrial and Applied Mathematics; 2 edition (March 2005)

Desmond J. Higham An Introduction to Financial Option Valuation: Mathematics, Stochastics and Computation Cambridge University Press; 1 edition (April 19, 2004)

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Matlab'a giriş-Temel kavramlar-Değişkenler-Matris, vektör ve seriler
2	Temel kavramlar-Değişkenler
3	Looplar-Fonksiyonlar
4	Input-Output
5	Grafikler
6	Lineer cebir
7	Çözüm-Optimizasyon
8	Opsiyonlar
9	Opsiyon değerlemeye giriş
10	Rastsal değişkenler-Simülasyon
11	Aktif fiyat hareketleri
12	Aktif fiyat modeli I
13	Aktif fiyat modeli II