



אוניברסיטת בן-גוריון בנגב
הפקולטה למדעי הרוח והחברה
המחלקה לכלכלה

שם הקורס בעברית: תמחור של מכשירים פיננסיים
Pricing of Financial Tools

מס' קורס: 142-1-0177

שם המרצה: עזרא עיני

יעדי ההוראה:

מטרת הקורס היא להקנות את הכלים המתמטיים שבעזרתם מתמחרים מכשירים פיננסיים.

The purpose of the course is to study the mathematical methods used in pricing of financial tools.

פרשיות לימודים:

במהלך הקורס נכסה את הנושאים הבאים:
מושג הארביטראג'. משפט האפיון של ארביטראג'. תמחור של חוזים באמצעות ארביטראג'. המודל הבינומי. הנוסחה של Black-Scholes ושימושיה. תמחור של אופציות אירופאיות ואמריקאיות. תכנון דינמי טווכסטי.

During the course we will cover the following subjects:
The notion of arbitrage. The arbitrage theorem. Pricing contracts via arbitrage. The binomial model. The Black-Scholes formula and its applications. Pricing of European and American options.

דרישות והרכב ציון הקורס

משקל בציון הסופי	
בחירה -	נוכחות
100 % -	מבחנים
100% -	סה"כ

רשימה ביבליוגרפית:

Ross S.M: An Elementary Introduction to Mathematical Finance. Cambridge University Press 2011.