

**ОБОЗРЕНИЕ
ПРИКЛАДНОЙ И ПРОМЫШЛЕННОЙ**

Том 18

МАТЕМАТИКИ

Выпуск 2

2011

Секция «Финансовая и страховая математика»

ЗВЕРЕВ О. В., ХАМЕТОВ В. М.

**МИНИМАКСНОЕ ХЕДЖИРОВАНИЕ ОПЦИОНОВ
ЕВРОПЕЙСКОГО ТИПА НА НЕПОЛНЫХ РЫНКАХ
(ДИСКРЕТНОЕ ВРЕМЯ). II ¹⁾**

Содержание

§ 5. Минимаксный хеджирующий портфель европейского опциона на конечном $(1, S)$ -рынке	193
§ 6. Пример	202
Список литературы	204