

Finanskontakt 2006



KTH Teknikvetenskap

Strukturerade finansiella transaktioner i teori och praktik

3 maj 2006 kl 17-20 i sal D2, KTH

KTH:s och Algorithmica Researchs syfte med Finanskontakt är att skapa kontakter mellan KTH:s studenter på Finansiell matematik och det privata näringslivet. Vår förhoppning är att denna kontakt ska hjälpa till att skapa ett kunskaps- och erfarenhetsutbyte mellan näringsliv och högskola.

Årets Finanskontakt har strukturerade affärer som gemensamt tema. Från finanssektorn kommer SEB Merchant Bankings Fredrik Fyring att prata om Arbetet på en 'Structured Products Desk'. Från Handelshögskolan i Stockholm kommer Irina Slinko att prata om Option pricing in incomplete markets.

Programmet

Inledning - KTH och Algorithmica Research

*Irina Slinko, Department of Finance,
Stockholm School of Economics*

Option pricing in incomplete markets (föredraget hålls på engelska)

- An overview of different methods of finding prices/pricing bounds for derivatives in incomplete markets
- Presentation of the approach in Björk and Slinko (2004). In markets where incompleteness is caused by a jump process, we apply the idea of ruling out not only those prices which are violating the no arbitrage restriction, but also those prices which in some sense would represent "deals which are too good".

*Fredrik Fyring, TCM Sales/Structured Products,
SEB Merchant Banking*

Vilka dagliga problem möter man på en Structured Products desk?

- Vad är 'strukturerade produkter'?
- Dataproblem: Volatiliteter, korrelationer, utdelningar
- Systemproblem: Vilka problem hanteras – och hur
- Fallstudier: Asian options, cliquets och barrier options

Lätt förtäring och frågestund.

För att hitta till sal D2: gå genom KTH:s huvudentré genom järngrinden. i valvet, se skyltar.

Anmälan

Studenter anmäler sig till Boualem Djehiche (boualem@kth.se). Övriga deltagare anmäler sig på www.algorithmica.se. Inbjudan är personlig. Begränsat antal platser i lokalen. Anmälan bör därför ske snarast.

Seminarier är gratis för alla och Algorithmica Research bjuder på förtäring.