

# Χρηματοοικονομικά Μαθηματικά Εργασίες 2024

Επιλέξτε ΕΝΑ απο τα παρακάτω θέματα

1. Μετρα κινδύνου, θεωρία υπολογισμός και εφαρμογές.
2. Επιλογή χαρτοφυλακίου και βελτιστοποίηση: Θεωρία, υπολογισμός και εφαρμογές
3. Μοντέλα χρονολογικών σειρών για τις αποδόσεις χρηματοοικονομικών τίτλων: Garch και επεκτάσεις, θεωρία, υπολογισμός και εφαρμογές
4. Αμερικανικά παράγωγα προϊόντα: Θεωρία, υπολογισμός και εφαρμογές
5. Τεχνικές μηχανικής μάθησης στα χρηματοοικονομικά: Θεωρία, υπολογισμός και εφαρμογές

Ενδεικτική βιβλιογραφία

1. Mc Neil, Frey Embrechts Quantitative Risk Management
2. Cornejo, Tutuncu, Optimization methods in Finance 2018 CUP
3. Tsay, Analysis of financial time series, Willey 2005 and 1.
4. Privault Lecture notes <https://personal.ntu.edu.sg/nprivault/MA5182/american-options.pdf>
5. Financial Machine Learning Bryan T. Kelly and Dacheng Xiu July 2023