

სამაქტივიანი ფინანსური ბაზრის შესახებ

ბესარიონ დოჭვირი^{*}, მზევინარ ფაცაცია^{**}, ვახტანგ ჯაოშვილი^{***}

^{*} ივ. ჯავახიშვილის სახელობის თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტი, მათემატიკის
დეპარტამენტი, თბილისი, საქართველო, besarion.dochviri@tsu.ge

^{**} სოხუმის სახელმწიფო უნივერსიტეტი, მათემატიკისა და კომპიუტერულ მეცნიერებათა
ფაკულტეტი, თბილისი, საქართველო, mzevip54@mail.ru

^{***} ივ. ჯავახიშვილის სახელობის თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტი, მათემატიკის
დეპარტამენტი, თბილისი, საქართველო, vakhtangi.jaoshvili@gmail.com

განხილულია ფინანსური ბაზარი, რომელიც შედგება სამი აქტივისგან: ორი საბანკო ანგარიშისგან (ორი ობლიგაციისგან) და აქციისგან. მიღებულია საპროცენტო განაკვეთისა და მარტინგალური ზომების ცხადი რეკურენტული გამოსახულებები.

დამტკიცებულია ფინანსური ბაზრის არაარბიტრაჟულობა და სისრულე. მოტანილია ევროპული ტიპის ყიდვის სტანდარტული ოფციონის ფასდადების ორნაბიჯიანი ამოცანის გადაწყვეტის საილუსტრაციო რიცხვითი მაგალითი.

Acknowledgement. This work was supported by Shota Rustaveli National Science Foundation Grant No FR/308/5-104/12.