

- **Зверев О.В.** (к.ф.-м.н., старший научный сотрудник лаборатории стохастической оптимизации и теории риска Центрального экономико-математического института РАН);
- **Шелемех Е.А.** (к.ф.-м.н., научный сотрудник лаборатории стохастической оптимизации и теории риска Центрального экономико-математического института РАН)

***Теоретико-игровой подход к решению задачи расчёта опциона на неполном рынке.***

В докладе будет описан теоретико-игровой подход к решению задачи расчета европейского опциона на неполном рынке с дискретным временем в стохастической постановке, сформулирована антагонистическая игра эмитента опциона и рынка, установлен критерий существования игрового равновесия и соответствующей стратегии эмитента опциона. Будет показано, что предложенный подход позволяет построить суперхеджирующий портфель с минимальным капиталом (среди всех суперхеджирующих портфелей), равным цене игры и верхней цене хеджирования опциона.