

dr Przemysław Rola
Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie

Arbitraż i asymptotyczny arbitraż na rynkach z bid-ask spreads

W pracy [1], w której rozważamy model rynku z lokatą bankową oraz procesami bid (kupna) i ask (sprzedaży), podane zostały warunki równoważne dla braku arbitrażu. Podczas referatu przedstawimy najważniejsze wyniki tej pracy, a następnie wprowadzimy model dużego rynku finansowego (*large financial market*) z procesami bid i ask. W dalszej części zastanowimy się nad rozszerzeniem omówionych rezultatów na przypadek asymptotycznego arbitrażu.

Literatura

- [1] P. Rola, *Arbitrage in markets with bid-ask spreads*, <http://arxiv.org/abs/1407.3372>