



시장에 투자하기

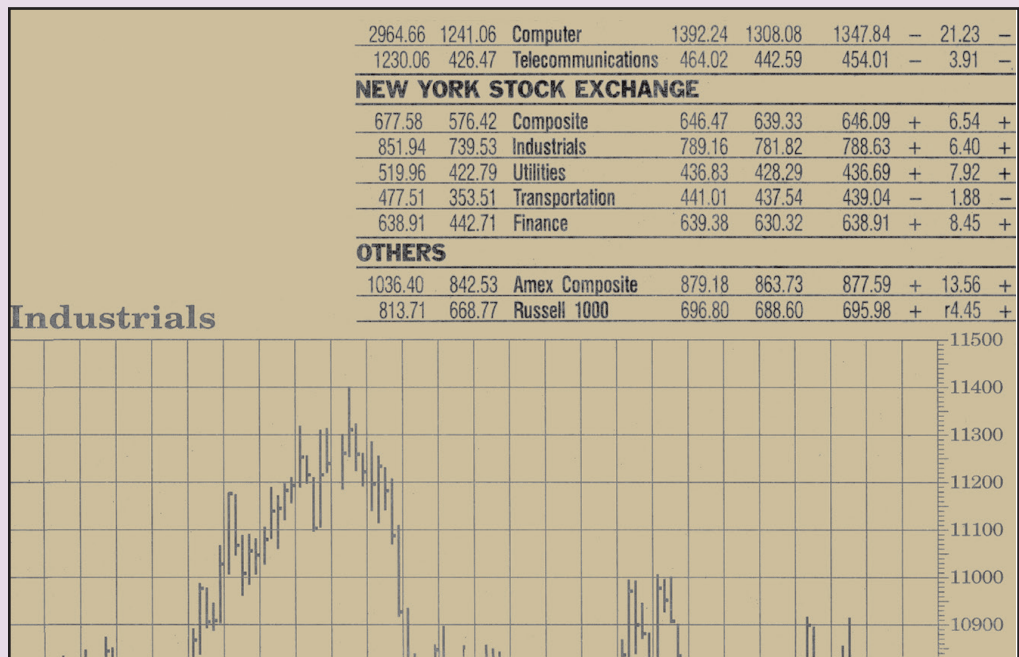
경제를 이끌어가는 데 도움을 준 파생상품과 같은 복잡한 금융 도구들이 지난 20년 동안 많이 개발되었습니다. 금융 파생상품은 그 가치가 어떤 다른 것의 가치에 의해 파생되는 수학적 도구로, 위험하다고 보는 이들도 있지만 그 의도는 위험을 다른 것들과 나눔으로써 줄이는 데에 있습니다.

선물 옵션의 현재가는 다변수 적분으로 근삿값을 계산합니다. 하지만 옵션 구성 요소의 수가 늘수록 다변수 적분의 복잡성은 기하급수적으로 증가합니다. 그래서 전통적인 근삿값 계산법은 곧 컴퓨터 계산의 영역을 넘어섭니다. 새로운 방법(저(低) 불일치도 수열을 사용하는 준-몬테카를로 방법)은 훨씬 정확한 결과를 제공하면서도 필요한 표본의 양은 더 적습니다. 이러한 방법으로 원하는 계산이 가능해집니다.

더 알아보기:

What's Happening in the Mathematical Sciences, Vol. 3, Barry Cipra.

Translation courtesy of volunteer members of the Korean Mathematical Society.



Mathematical Moments 프로그램은 과학, 자연, 기술, 그리고 인간의 문화에서 수학이 하는 역할에 대한 올바른 평가와 이해를 촉진합니다.

www.ams.org/mathmoments