

Im Sommersemester 2008 halte ich die Vorlesung

Finanzmathematik II

Inhalt:

Zeitstetige Modelle der Finanzmathematik, Diffusionsmodelle und Martingalmethoden, Anwendung auf die Bewertung und Absicherung von derivativen Finanzinstrumente und Portfoliooptimierung.

Voraussetzungen:

Grundvorlesungen (Analysis 1+2, Teilmodul Maßtheorie, Lineare Algebra 1+2), Stochastik II (Empfohlen, aber nicht Voraussetzung: Stochastische Analysis (!), Finanzmathematik I)

Literatur:

Lamperton, D.; Lapeyre, B.: Stochastic Calculus Applied to Finance, Chapman Hall, 1996.
Björk, T.: Arbitrage Theory in Continuous Time, Oxford Univ. Press, 2004.
Shreve, S.: Stochastic Calculus for Finance II, Springer, 2000.

Ort und Zeit:

Mo, 13.00 – 15.00 Uhr, Rudower Chaussee 25, Raum 3.008

Mi, 09.00 - 11.00 Uhr, Rudower Chaussee 26, Raum 0'311

Beginn: **am 16. 04. 2008**

Übungen: Mo, 15.00 - 17.00 Uhr, Rud. Chaussee 26, Raum 1'304 (I. Penner)

Sprechstunden: **nach Vereinbarung**

