

Seminar

Wahrscheinlichkeitstheorie (Finanzmathematik)

Prof. H.-J. Engelbert

WS 2008/09

Umfang: 2 SWS

Zielgruppe: Studierende im Hauptstudium MD und WMD mit Vertiefungsrichtung Stochastik

Das Seminar soll sich im WS 2008/09 mit Themen aus der Finanzmathematik befassen. Dabei sollen die Schwerpunkte

- Arbitrage Theorie

und

- Portfolio Optimierung

Berücksichtigung finden. Als Grundlage für das Seminar soll das Buch von H. Föllmer und A. Schied „*Stochastic Finance. An Introduction in Discrete Time*“, De Gruyter, Berlin 2004, Chapter 1-3, dienen. Insbesondere soll in den Vorträgen die Theorie an Hand von sogenannten Einperioden-Modellen dargestellt werden, was wesentlich zur Vereinfachung der zu verwendeten Techniken beiträgt.

Voraussetzung für die Vergabe von Leistungspunkten (3 CP) ist die regelmäßige Teilnahme, ein gehaltener Vortrag zum Thema und seine schriftliche Ausarbeitung.

Um Einschreibung wird gebeten. Eine Liste liegt im Sekretariat des Institutes für Stochastik (Raum 3523, Ernst-Abbe-Platz) aus. Die Vergabe der Vortragsthemen an die Teilnehmer erfolgt zur ersten Seminarzeit am Dienstag, dem 21. Oktober 2008, 12:00 Uhr, SR 3517, Ernst-Abbe-Platz.