

Prof. Dr. D. Becherer
<http://www.math.hu-berlin.de/~becherer>
Institut für Mathematik
Stochastik



Im Wintersemester 2013/14 halte ich die Vorlesung

Stochastische Finanzmathematik I

Inhalt:

Einführung in zeitlich diskrete stochastische Finanzmarktmodelle und die entsprechenden martingaltheoretischen und funktionalanalytischen Methoden: Arbitragefreiheit und Martingalmaße, Finanzderivate und ihre Bewertung, Black-Scholes-Formel, Absicherungsstrategien, optimales Stoppen und amerikanische Optionen, ggf. elementare Einführung in zeitstetige Modelle

Voraussetzungen:

Lineare Algebra und Analytische Geometrie I und II, Analysis I und II, Maßtheorie, Stochastik I; Stochastik II (sollte ggf. parallel gehört werden)

Literatur:

Hauptreferenz: Föllmer, H.; Schied, A.: Stochastic Finance
Ergänzend: Bingham, N.H.; Kiesel, R.: Risk-Neutral Valuation
Elliott, R.J.; Kopp, E.P.: Mathematics of Financial Markets
Hull, J.: Options, Futures, and Other Derivatives (praktische Aspekte)
Klenke, A.: Wahrscheinlichkeitstheorie (W.theorie, insbes. auch Martingale)

Vorlesung (Prof. Becherer):

Mi, 09 – 11 Uhr, RUD 26, Raum 0'311
Mi, 11 – 13 Uhr, RUD 25, Raum 1.013

Beginn: am 16. 10. 2013

Übung (Martin Büttner):

Mo, 13 – 15 Uhr, RUD 26, Raum 1'304

Sprechstunden: nach Vereinbarung