

Seminarankündigung für das SS 2010

Finanzmathematik

Inhalt:

Das Seminar soll die Inhalte der Vorlesung *Finanzmathematik I* (diskrete Zeit) des WS 2009/10 weiter vertiefen und ergänzen. Zu den geplanten Themen zählen:

- Monetäre Risikomaße
- Superreplikation von Europäischen und Amerikanischen bedingten Auszahlungen
- Effiziente Absicherung
- Minimierung des Absicherungsfehlers

Die Seminarvorträge basieren auf dem Lehrbuch

Föllmer, H., Schied, A., *Stochastic Finance*, 2. Auflage, de Gruyter, 2004.

Vorkenntnisse:

Die Teilnahme am Seminar setzt gute Grundkenntnisse im Bereich der Stochastik, etwa im Umfang der Vorlesungen Stochastik I und Stochastik II, voraus. Vorkenntnisse aus der Vorlesung Finanzmathematik I sind hilfreich, jedoch nicht zwingend erforderlich.

Anmeldung:

Bei Interesse am Seminar sollte die Anmeldung, vorzugsweise bis zum 15. Februar 2010, per E-Mail an T. Knispel (knispel@stochastik.uni-hannover.de) erfolgen. Für weitere Fragen steht T. Knispel (Raum F 450) zur Verfügung.