

Prof. Dr. H. Luschgy

Vorlesungsankündigung für SS 2011

Stochastische Prozesse II (und Math. Finance)

Zeit: Di, Do 12 - 14
Ort: HS 8, HS 5
Beginn: 12.04.2011
Übungen: Do 14 - 16, E 45

Stochastische Integrale und stochastische Differentialgleichungen bilden die Basis der Preistheorie derivater Finanzprodukte in zeitstetigen Marktmodellen. In der Vorlesung werden Aspekte der stochastischen Analysis dargestellt. Als Anwendung wird z.B. die Preistheorie für exotische Optionen im Black-Scholes Finanzmarktmodell besprochen.

Die Vorlesung ist als Fortsetzung der Vorlesung "Stochastische Prozesse I" vom WS 2010/11 geplant.

Ausgewählte Literatur:

Arnold, L. (1973): Stochastische Differentialgleichungen. Oldenbourg Verlag.

Deck, T. (2006): Der Ito-Kalkül. Springer

Elliott, R.J., Kopp, P.E. (1998): Mathematics of Financial Markets. Springer

Irle, A. (1998): Finanzmathematik. Teubner

Revuz, D., Yor, M. (1991): Continuous Martingales and Brownian Motion. Springer