

Prof. Dr. H. Luschgy

Vorlesungsankündigung für WS 2009/10

Stochastische Finanzmarktanalyse (Stochastic Finance)

Zeit: Do 14 - 16

Ort: E 10 – Vorerst!

Beginn: 5.11.2009

In der Vorlesung werden zeitstetige Multiasset-Finanzmarktmodelle untersucht. Spezielle Themen sind: Markovmodelle, Währungsmärkte und Währungsoptionen, Marktmodelle mit stochastischer Volatilität. Explizite Preisformeln für etliche Optionen (2-colour rainbow Optionen, Exchange Optionen, Elf-X call,...) werden hergeleitet.

Voraussetzung: gute Kenntnisse der „Brownschen“ stochastischen Analysis.

Ausgewählte Literatur:

Björk, T. (1998): Arbitrage Theory in Continuous Time. Oxford University Press.

Fouque, J.-P., Papanicolaou, G., Sircar, K. R. (2000): Derivatives in Financial Markets with Stochastic Volatility. Cambridge University Press.

Karatzas, I., Shreve, S.E. (1998): Methods of Mathematical Finance. Springer.

Korn, R., Korn, E. (1999): Optionsbewertung und Portfoliooptimierung. Vieweg.

Shreve, S. E. (2004): Stochastic Calculus for Finance, Vol. II. Springer