

"Konvexe Analysis, Dualität und Anwendungen"

Liste der Vorträge

Konvexe Analysis und Dualität

- Lagrange-Dualität
- Fenchel-Konjugation
- Fenchel-Dualität

Spezielle Funktionen

- Abstandsfunktion Punkt-Menge
- Stützfunktion: Grundlagen
- Stützfunktion: Beispiele, Anwendungen
- Polykonvexe Funktionen – Theorie, Beispiele

Anwendungen in der Finanzmathematik

- Finanzmarktmodell und Preisbildung – Grundlagen
- Superhedging – Dualität
- Abweichungsmaße und Risikoanalyse
- Abweichungsmaße und Portfolio-Optimierung

Anmeldung für einen Vortrag auch bei: Karla.Rietz@math.uni-leipzig.de