

Miniworkshop Finanzmathematik

15. Oktober 2003

08:30 – 09:45 Sebastian Maaß, Uni Bremen:
„Verbindungen zwischen nicht-additiver und sigma-additiver Maß- und Wahrscheinlichkeitstheorie: Core und Möbius-Transformation“

09:45 – 11:00 Christian Bender, Uni Konstanz:
„Ein diskretes Analogon zum fraktionalen Black-Scholes-Markt“

11:15 – 12:30 Thorsten Schmidt, Uni Gießen:
„Modellierung von Credit Risk“

Mittagspause

13:30 – 14:45 Angelika Esser, Uni Frankfurt:
„Attainability of European Path-Independent Claims in Incomplete Markets“

14:45 – 16:00 Jörg Neunhäuserer, Goslar:
„Resultate über selbst-ähnliche Wahrscheinlichkeitsmaße und deren Anwendungen“

Bei den Vorträgen handelt es sich um die Vorstellungsvorträge im Berufungsverfahren für die Juniorprofessur Finanzmathematik und angrenzende Gebiete.

Organisation: Professor Dr. Rüdiger Frey

Bei Fragen wenden Sie sich bitte an Frau Claudia Götz, goetz@math.uni-leipzig.de

Ort: Felix-Klein-Hörsaal im Hauptgebäude, Augustusplatz 10/11, 04109 Leipzig