

Prof. Dr. Max v. Renesse
Mathematisches Institut
Universität Leipzig

Ankündigung Fachseminar im SoSe 13

Unvollständige Märkte in Diskreter Zeit

Inhalt:

Unvollständige Finanzmärkte zeichnen sich durch die Existenz von Risiken aus, die nicht durch bereits vorhandene Instrumente abgesichert werden können. In der Praxis ist dies der Regelfall. Die mathematische Theorie der unvollständigen Märkte behandelt im wesentlichen Optimierungsverfahren, um solche Risiken wenigstens approximativ abzusichern.

Im Seminar werden die wichtigsten Ansätze in Modellen mit diskreter Zeitachse behandelt. Hierdurch wird der technische Aufwand gering gehalten, so dass die Konzepte im Vordergrund stehen.

Zielgruppe:

Studierende für den Abschluss Diplom in (Wirtschafts-) Mathematik ab dem 5. Semester.

Vorraussetzungen:

W-Theorie 1 und Finanzmathematik I, bzw. Föllmer/Schied "Stochastic Finance", Kap. 1, 5, 6

Vorbesprechung:

Mittwoch, den 30. Januar um 13.30 in Seminarraum 3-12 (SG)

Für Nachrücker:

Anmeldung auch verspätet in meiner Sprechstunde, Dienstags 13.30 -15.00 in A 337 möglich.