

t.MF2 - Mathematik der Finanzmärkte 2

Kursverantwortung: Wolfgang Breymann, bwlf
Credits: 4
Schuljahr: 2009/2010
Zuletzt gespeichert: 18.08.2010 10:52

Lernziel:

Die Studierenden sind mit weiterführenden Methoden zur Modellierung von Finanzmärkten im Rahmen der modernen Finanzmathematik vertraut und können diese Themen praktisch umsetzen.

Lerninhalt:

Laufzeitabhängigkeit der Zinsen (Zinsstrukturkurve, Kassazinsen und Terminzinsen),
 Zeit-diskrete Mehr-Perioden-Modelle, insbesondere stochastische Modelle der Marktdynamik (additive und multiplikative Modelle),
 Bewertung von Derivaten (Terminkontrakte, europäische und amerikanische Optionen),
 Black-Scholes-Formeln,
 Risiko-neutrale Preisbestimmung.

Vorkenntnisse:

Mathematik der Finanzmärkte 1

Durchführung:

Unterrichtsart	Anzahl Lektionen pro Woche
Vorlesung	14x(2L+2L)
Übung/Praktika	
Gruppenunterricht	
Blockunterricht	
Seminar	

Leistungsnachweise:

Laut Tabelle oder gemäss schriftlicher Festlegung des Dozierenden zu Semesterbeginn!

Anzahl	Art	Gewichtung
1	Modulendprüfung	3
1	Prüfungen während Unterrichtszeit	1
	Weitere Leistungsnachweise	

Unterrichtssprache:

Deutsch

Unterrichtsunterlagen:

Skript

Bemerkungen:

-