

t.MF2 - Mathematik der Finanzmärkte 2

Kursverantwortung: Wolfgang Breymann, bwlf
Credits: 4
Schuljahr: 2010/2011
Zuletzt gespeichert: 13.09.2010 14:23

Lernziel:

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

Lerninhalt:

Zeit-diskrete und zeit-stetige Mehr-Perioden-Modelle, insbesondere stochastische Modelle der Marktdynamik (additive und multiplikative Modelle, (geometrische) Brownsche Bewegung), stochastige DGL und Ito-Lemma, Bewertung von Derivaten (Terminkontrakte, Optionen)

Vorkenntnisse:

MF1, Mathematik, Statistik und Ökonomie-Ausbildung der WI-WM Studienrichtung der Semester 1-4

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
1	Weitere Leistungsnachweise	1

Unterrichtssprache:

Deutsch

Unterrichtsunterlagen:

Lehrbuch von D. Luenberger: Investment Science.
Vorlesungsskript.

Bemerkungen:

-