

t.MF1 - Mathematik der Finanzmärkte 1

Kursverantwortung: Wolfgang Breymann, bwlf
Credits: 4
Schuljahr: 2011/2012
Zuletzt gespeichert: 08.05.2012 15:08

Lernziel:

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

Lerninhalt:

Prinzipien der Modellierung von Finanzmärkten (Arbitrage, Replikation, Vollständigkeit),
 1-Perioden-Wertpapiermärkte,
 Risikodiversifizierung,
 Portfolioanalyse,
 Mittelwert-Varianz-Optimierung,
 Capital Asset Pricing Model,
 Asset Pricing Theory,
 Faktormodell

Vorkenntnisse:

Mathematik-, Statistik- und Ökonomieausbildung der Semester 1-3 der WI-WM-Studienrichtung.

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:

-