

Seminar zur Finanzmathematik SS 2010
PD Dr. Volkert Paulsen

Literatur:

1. Rose-Anne Dana, Monique Jeanblanc; Financial Markets in Continuous Time; Springer
2. Freddy Delbaen, Walter Schachermayer; The Mathematics of Arbitrage; Springer
3. R.J. Williams; Introduction to the Mathematics of Finance; American Mathematical Society
4. Mc Neil, Frey, Embrechts; Quantitative Risk Management; Princeton University Press
5. Musiela, Rutkowski; Martingale Methods in Financial Modeling; Springer
6. V. Paulsen; Bounds for the American Perpetual Put on a Stock Index; Journal of Applied Probability 38, p 55-66 (2001)
7. S. Shreve; Stochastic Calculus for Finance I; Springer
8. A. Irle; Finanzmathematik; Teubner
9. Föllmer, Schied; Stochastic Finance; de Gruyter
10. F. Brinkmann; Ein dynamisches Modell zur Bewertung von Collateralized Debt Obligations ; Diplomarbeit Universität Münster 2009
11. S. Shreve; Stochastic Calculus and Finance; Script
12. Pliska; Introduction to Mathematical Finance; Blackwell
13. M. Beibel, H.R.Lerche; A new look at optimal stopping problems related to mathematical finance; Statistica Sinica Vol. 7 No. 1 pp 93-108

Name	Studiengang	Termin	Thema	Literatur	Nummer	Betreuer
Deniz Atug	Diplom	13. Apr	Bewertung von Barriere Optionen im BS-Modell, die Symmetrie von Carr	[1.] Kap. 9.3-9.5, S. 256-271	1.	Ebbers
Susanna Wankmüller	Diplom	20. Apr	Bewertung von Barriere Optionen im CRR Modell	[12] Abschnitt 3.5, Beispiel 4.7; [7.] Kapitel 5	2.	Ebbers
Henning Katerkamp	Diplom	27. Apr	Bewertung von amerikanischen Basketoptionen	[6.], [13.] Beispiel 2.1	3.	Ebbers
Marleen Laakmann	Diplom	04. Mai	Das Mertonsche Firmenwertmodell zur Beschreibung von Kreditrisiken	[4.] Kap. 8.2 S. 331-342	4.	Paulsen
Katharina Hasow	Bachelor	11. Mai	Portfoliooptimierung im Mehrperioden-Modell	[2.] Kap. 3 S. 33-57	5.	Paulsen
Anastasia Au	Bachelor	18. Mai	Upper and lower hedging im Mehrperioden-Modell	[2.] Kap. 2 S. 11-31	7.	Ebbers
Nadja Amedsin	Bachelor	25. Mai	Bewertung von amerikanischen Optionen im CRR Modell	[3.] Kap. 2.3 S. 19-28	8.	Ebbers
Johannes Kuhn	Bachelor	02. Jun	Der Zusammenhang zwischen Arbitragefreiheit und Portfoliooptimierung	[9.] Kap. 3.1,3.2	6.	Ebbers
Stefanie Tiemann	Bachelor	09. Jun	Bewertung von exotischen Optionen im CRR Modell	[11.] Kap. 4.5 S. 75-77	9.	Ebbers
Johannes Blank	Bachelor	16. Jun	ARMA Prozesse zur Modellierung von stationären Zeitreihen	[4.] Kap. 4.2 S. 125-139	10.	Ebbers
Frauke Heuermann	Bachelor	23. Jun	Das Garch Modell zur Modellierung von Finanzmarktzeitreihen	[4.] Kap. 4.3 S. 139-158	11.	Ebbers
Florian Heisel	Diplom	30. Jun	Der Fixpunktsatz von Brower und die Existenz von Gleichgewichtspreisen	[1.] Kap. 6.1-6.3	12.	Paulsen
Sven Lammers	Diplom	06. Jul	Existenz von Gleichgewichtspreisen bei Unsicherheit	[1.] Kap. 6.4-6.7	13.	Paulsen
Kai Knipping	Diplom	13. Jul	Existenz von Gleichgewichtspreisen in zeitstetigen Modellen	[1.] Kap. 7	14.	Paulsen
Daniel Schlotmann	Diplom	20. Jul	Ein Markov-Prozeß Ansatz zur Modellierung von Collateralized Debt Obligations	[10.]	15.	Paulsen