

Tabelle1

Seminar zur Finanzmathematik SS 2011
PD Dr. Volkert Paulsen

- Literatur:
1. Föllmer, Schied; Stochastic Finance; de Gruyter dritte Auflage
 2. Fusai, Roncoroni; Implementing Models in Quantitative Finance; Springer
 3. Back; A Course in Derivative Securities; Springer
 4. Buff; Uncertain Volatility Models; Springer
 5. Mc Neil; Extrem Value Theory or Risk Managers;
 6. V. Paulsen; Bounds for the American Perpetual Put on a Stock Index; Journal of Applied Probability 38, p 55-66 (2001)
 7. Gieseke; Credit Risk Modelling and Valuation;
 8. A. Irle; Finanzmathematik; Teubner

Name	Studiengang	Termin	Thema	Literatur	Nummer	Betreuer
Sebastian Wessels	Diplom	03.Mai	Der Mertonsche Firmenwertansatz	7. Kap. 2	1.	Paulsen
Dirk Stöppel	Bachelor	10. Mai	Approximation des Black-Scholes Modells	1. Kap. 5.7	2.	Surulescu
Peter Wellmann	Bachelor	17. Mai	Die gleichmäßige Doob-Zerlegung für Supermartingale	1. Kap. 7.1-7.3	3.	Surulescu
Timo Wesendahl	Bachelor	24.Mai	Statisches Replizieren	1. Kap. 7.4	4.	Surulescu
Sven Golhke	Bachelor	31. Mai	Die Kunita-Watanabe Zerlegung	1. Kap. 10.1, 10.2	5.	Surulescu
Eugenia Bondar	Bachelor	07. Jun	Varianzoptimales Replizieren	1. Kap 10.3	6.	Surulescu
Leo Bronstein	Bachelor	21. Jun	Zur Bewertung von Basketoptionen	8. Kap. 4, 6.	7.	Paulsen
Patrick Wolff	Bachelor	28. Jun	Dynamic Monte-Carlo	2. Kap. 2	8.	Surulescu
Erik Santen	Bachelor	05. Jul	PDE Methoden zur Bewertung von Finanzderivaten	2. Kap. 4, 3. Kap. 10	9.	Surulescu