

Seminar zur Finanzmathematik SS 2012
PD Dr. Volkert Paulsen

Literatur:

1. Föllmer, Schied; Stochastic Finance; de Gruyter dritte Auflage
2. A. Irle; Finanzmathematik; Teubner
3. Pliska; Introduction to Mathematical Finance
4. Delbaen, Schachermayer; The Mathematics of Arbitrage
5. Emilio Barucci; Financial Markets Theory
6. John van der Hoek, Robert J. Elliot; Binomial Models in Finance
7. Andrea Pascucci; PDE and Martingale Methods in Option Pricing
8. Volkert Paulsen; Zur Bewertung von Derivaten - Eine Einführung; <http://wwwmath.uni-muenster.de/statistik/paulsen/WeiterePublikationen/>
9. Elliot, Kopp; Mathematics of Financial Markets;
10. S. Shreve; Stochastic Calculus for Finance I, The Binomial Asset Pricing Modell
11. R. Williams; Introduction to the Mathematics of Finance
12. S. Shreve; Stochastic Calculus for Finance II;
13. R.A. Dana, M. Jeanblanc; Financial Markets in Continuous Time
14. Sean Dineen; A Mathematical Guide to the Black-Scholes Formula
15. Klaus Sandmann; Einführung in die Stochastik der Finanzmärkte
16. H. Pham; Large Deviation in Finance, Script of a lecture held at a summer school
17. J. Kremer; Portfoliotheorie, Risikomanagement und die Bewertung von Derivaten
18. Gerber; Lebensversicherungsmathematik
19. Bühlmann, Gisler; A Course in Credibility Theorie and its Applications

Name	Studiengang	Termin	Thema	Literatur	Nummer	Betreuer
Jörn Borrink	Bachelor	17. Apr	Eine Einführung in die Finanzmathematik			
Kevin Schuler	Bachelor	24. Apr	Zur Bewertung von Finanzderivaten in zeitdiskreten Modellen			
Hendrik Zelle	Bachelor	08. Mai	Algorithmische Verfahren zur Berechnung der Preise von Finanzderivaten			
Christoph Tenbrock	Bachelor	15. Mai	Zur Bewertung von amerikanischen Optionen			
Sven Upgang	Bachelor	22. Mai	Das klassische Black-Scholes Modell			
Veronika Beier	Bachelor	05. Jun	Eine Einführung in die mikroökonomische Gleichgewichtstheorie			
Benjamin Kraska	Master	12. Jun	Der Markowitzansatz zur Portfoliooptimierung			
Maren Urner	Bachelor	19. Jun	Das Prinzip großer Abweichungen und dessen Anwendung in der Finanzmathematik			
Timo Wesendahl	Master	26. Jun	Eine Einführung in die Sachversicherungsmathematik			
Sven Gohlke	Master	03. Jul	Eine Einführung in die Credibility Theorie			
Sariye Demir	Master	10. Jul	Eine Einführung in die Lebensversicherungsmathematik			

mathetage.pdf

|Note |