

VORLESUNG FINANZ- und VERSICHERUNGSMATHEMATIK II

H.-J. Bartels

Termin: Mo. 10.15-11.45 Uhr u. Mi. 10.15-11.45 Uhr

Vorlesungsbeginn: 1.9.2014

Hörsaal: C013

Übungen zur Vorlesung: Mi. 13.45-15.15 Uhr, C013

Die Vorlesung ist die Fortsetzung der im Frühjahrssemester begonnenen Vorlesung. **Der Stoff der Vorlesung Finanz- und Versicherungsmathematik I wird nicht vorausgesetzt**, da im Herbstsemester überwiegend Fragen der modernen Finanzmathematik behandelt werden. Der Stoff der Vorlesung wendet sich an Studenten der Mathematik mittlerer Semester mit Interesse an Fragen der Wirtschafts- und Finanzmathematik.

Hierbei geht es u.a. auch um Anwendungen der Stochastik auf Fragen der Finanzmathematik, wie z.B. Optionspreismodelle und Modelle für die Berechnung von Zinsderivaten.

Der Stoff der Vorlesung wendet sich an Studenten der Mathematik mittlerer Semester mit Interesse an Fragen der Wirtschaftsmathematik und **Kenntnissen in Wahrscheinlichkeitstheorie**.

Literatur zur Vorlesung:

D. Lamberton u. B. Lapeyre: Introduction to Stochastic Calculus Applied to Finance, Chapman Hall, London bzw. Taylor & Francis 2008

Weitere Literaturangaben erfolgen in der Vorlesung.