

www.mathfred.de
<http://home.htw-berlin.de/~jaegera/lehre.html>
www.htw-berlin.de/hochschule/personen/person/?typo3state=persons&lsfid=8754

Themen

1. Ein-Perioden-Finanzmarktmodell
2. Binomialbaummodell
3. Mathematik der Derivate
4. Entscheidung unter Unsicherheit
5. Mathematische Grundlagen des Risikomanagements
6. Portfoliooptimierung bezüglich erwarteter Rendite und Varianz

Unterrichtsmaterialien (insb. Skript und Aufgaben mit Lösungen) und Prüfungsbedingungen publiziere ich auf der Moodle-Seite, die ich zu dieser Veranstaltung einrichte. Suchen Sie in den unten genannten Quellen auch auf Basis des Skripts selbständig nach den entsprechenden Abschnitten.

Literatur

- Guiseppe **Compolieti**, Roman **Makarov**: Financial Mathematics, CRC Press
insbesondere für die Themen 1,2,3,4,6
- Clausia **Cottin**, Sebastian Döhler: Risikoanalyse, Springer
insbesondere für die Themen 5
- Pablo **Medina**, Sandro **Merino**: Mathematical Finance and Probability, Springer
- Stanley **Pliska**: Introduction to Mathematical Finance: Discrete Time Models, Wiley
insbesondere für das Thema 1
- Steven **Shreve**: Stochastic Calculus for Finance I, Springer
insbesondere für das Thema 2