

Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

Titel des Moduls	Finanzmathematik II
in englischer Sprache	

R	
A	X

	Vorlesung	Übung
Umfang	4	2

Inhalt	
Zeitstetige Modelle der Finanzmathematik. Diffusionsmodelle und Martingalmethoden. Anwendung auf die Bewertung und Absicherung von derivaten Finanzinstrumente, und Portfoliooptimierung.	

Voraussetzungen	Grundvorlesungen (Analysis I +II, Teilmodul Maßtheorie, Lineare Algebra und Analytische Geometrie I +II), Stochastik II Empfohlen, aber nicht Voraussetzung: Stochastische Analysis (ggf. parallel zu hören), Finanzmathematik I
------------------------	---

Regelsemester	Ab 5 oder 6 Fachsemester
----------------------	--------------------------

Abschluss	mündliche Prüfung oder Klausur, wird zu Beginn der VL bekannt gegeben
------------------	---

Prüfungszulassungsvoraussetzung	Abschluss Modul I und II
--	--------------------------

Studienpunkte	10
----------------------	----

R = Reine Mathematik
A = Angewandte Mathematik