

# Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

<b>Titel des Moduls</b>	<b>Finanzmathematik II</b>
in englischer Sprache	

<b>R</b>	
<b>A</b>	<b>X</b>

	Vorlesung	Übung
<b>Umfang</b>	4	2

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

<b>Voraussetzungen</b>	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
------------------------	---

<b>Regelsemester</b>	Ab 5 oder 6 Fachsemester
----------------------	--------------------------

<b>Abschluss</b>	mündliche Prüfung oder Klausur, wird zu Beginn der VL bekannt gegeben
------------------	---

<b>Prüfungszulassungsvoraussetzung</b>	Abschluss Modul I und II
--	--------------------------

<b>Studienpunkte</b>	10
----------------------	----

R = Reine Mathematik  
A = Angewandte Mathematik