



## Ankündigung Wintersemester 2009/2010

### Seminar Finanzmathematik

Das Seminar behandelt aktuelle Fragestellungen der Finanzmathematik. Es werden Modelle für den Finanzmarkt betrachtet, die über das klassische Black-Scholes-Modell hinausgehen. Eine zentrale Rolle spielen hier Modelle, in denen der Aktienkurs eine stochastische Volatilität und/oder eine zusätzliche Sprungkomponente besitzt. Neben der Bewertung und dem Hedging von Zahlungsansprüchen werden auch Portfoliooptimierungsprobleme betrachtet.

**Dozentin:** L. Veraart

**Zeit und Ort:** Donnerstag 8:00-9:30 Uhr, Raum 1C-01 (Allianz-Gebäude)

**Anmeldung:** Anmeldung bei Frau L. Veraart ([veraart@stoch.uni-karlsruhe.de](mailto:veraart@stoch.uni-karlsruhe.de))  
bis zum 29.07.2009.

**Vorbereitung:** Donnerstag 30.07.2009 10 Uhr, Raum 1C-01 (Allianz-Gebäude)

**Voraussetzungen:** Kenntnisse im Umfang der Vorlesungen Finanzmathematik 1 und Finanzmathematik 2.

**Webseite:** <http://www.mathematik.uni-karlsruhe.de/stoch/lehre/semfinanzmath2009w/>