

Seminar Stochastische Prozesse

Nr.	Datum	Name	Betreuer	Thema
1	17.04.2008	D. Joos	Bäuerle	Replizierende Strategie und Shortfallwahrscheinlichkeit im Binomialmodell mit Transaktionskosten
2	24.04.2008	M. Scheffler	Bäuerle	Optionspreisbestimmung im Binomialmodell mit Transaktionskosten
3	08.05.2008	O.Ripalda Zenck	Blatter	Zeitstetige Mean-Variance Portfolio-Selektion
4	15.05.2008	J. Wang	Blatter	Optimierung von Konsum, Portfolio und Minimierung der Volatilität
5	29.05.2008	T. Filatov	Blatter	Preisbestimmung von Zahlungsansprüchen auf nicht-handelbaren Assets
6	05.06.2008	N. Fuchs	Pfeiffer	Forwards und Futures im Cox-Ingersoll-Ross Modell
7	12.06.2008	R. Herma	Blatter	Optimale Portfolios von Assets niedriger Liquidität
8	19.06.2008	F. Brandt	Blatter	...
9	26.06.2008	E. Schüle	Bäuerle	Monotonieeigenschaften optimaler Investmentstrategien
10	03.07.2008	C. Ramöller, S: Urban	Bäuerle	Filterprobleme in diskreter und stetiger Zeit
11	10.07.2008	P. Schmalkoke	Bäuerle	Spezielle Filter für partiell beobachtbare Markov-Ketten

Anforderungen: Erstellung eines getippten Handouts (max. 3 Seiten), maximal 60minütiger Vortrag (egal ob Tafel, Folien, Beamer), Anwesenheit bei den übrigen Terminen.

Das Handout sollten Sie uns spätestens **1 Woche** vor dem Vortragstermin zukommen lassen.