

INFORMATIONSBLETT ZUR VL 'FINANZMATHEMATIK 1'

<https://isis.tu-berlin.de/course/view.php?id=6037>

	Raum	e-mail	Sprechstunde
Dozent: Prof. Dr. Antonis Papapantoleon	MA 703	papapan@math.tu-berlin.de	Di 11:00 - 12:00
Assistent: Moritz Voß	MA 712	voss@math.tu-berlin.de	Do 10:15 - 11:45

Termine

Vorlesungen:	Dienstag	14:15 - 15:45	Prof. Dr. Papapantoleon	MA 004	Beginn: 13.10.2015
	Mittwoch	14:15 - 15:45	Prof. Dr. Papapantoleon	MA 141	
Übung:	Freitag	10:15 - 11:45	Moritz Voß	MA 144	Beginn: 23.10.2015
	Freitag	12:15 - 13:45	Moritz Voß	MA 144	

Homepage zur Vorlesung

<https://www.isis.tu-berlin.de/2.0/course/view.php?id=1543>

Voraussetzungen

Es werden die Inhalte der Module "Analysis 1 & 2", "Lineare Algebra 1 & 2" und "Wahrscheinlichkeitstheorie 1" vorausgesetzt.

Empfehlenswert ist zudem "Wahrscheinlichkeitstheorie 2" (kann begleitend zur Vorlesung gehört werden).

Tutorieneinteilung

Jede Woche werden zwei Übungen angeboten. Der Inhalt der beiden Übungen ist identisch. Es ist daher ausreichend **nur eine der beiden** Übungen zu besuchen. Die Übung kann frei gewählt werden und es findet keine Einschreibung statt.

Hausaufgaben

Jeden Freitag erscheint auf der Homepage zur Vorlesung ein neues Hausaufgabenblatt, das in festen Gruppen **bestehend aus zwei bis drei - idealerweise drei - Studierenden** bearbeitet werden soll. Der Abgabetermin ist immer **Freitags zu Beginn der ersten (!) Übung** in der jeweils darauffolgenden Woche.

Die Hausaufgaben werden in den Übungen besprochen.

Um zur Modulprüfung am Ende des Semesters zugelassen zu werden, sind jeweils **50% der Gesamtpunktzahl** der **Blätter 1 bis 6** sowie der **Blätter 7 bis 12** zu erreichen. Das 1. Hausaufgabenblatt wird ab Donnerstag den 15.10.2015 auf der Homepage zur Verfügung stehen.

Modulprüfung

Die Modulprüfung ist **schriftlich**. Es werden zwei Termine angeboten (voraussichtlich am Ende der Vorlesungszeit und am Ende der darauffolgenden Semesterferien). Die genauen Termine werden noch bekannt gegeben.

Voraussetzung zur Klausur ist der Scheinerwerb.

Skript

Auf der Homepage werden ein Vorlesungsskript von Prof. Dr. Peter Bank (auf Deutsch) und Prof. Dr. Ullrich Horst (HU Berlin, auf Englisch) zur Verfügung gestellt, die alle in diesem Semester behandelten Themen sowie weitere Literaturempfehlungen enthalten.

Literatur

1. HANS FÖLLMER, ALEXANDER SCHIED, *Stochastic Finance: An Introduction in Discrete Time*, 3. Auflage, De Gruyter, 2011.
2. DAMIEN LAMBERTON, BERNARD LAPEYRE, *Introduction to Stochastic Calculus Applied to Finance*, 2. Auflage, Chapman and Hall/CRC Financial Mathematics, 2008.
3. STEVEN E. SHREVE, *Stochastic Calculus for Finance I: The Binomial Asset Pricing Model*, Springer, 2004.
4. STEVEN E. SHREVE, *Stochastic Calculus for Finance II: Continuous-Time Models*, Springer, 2004.
5. JOHN C. HULL, *Options, Futures, and Other Derivatives*, 8. Auflage, Prentice Hall, 2011.
6. ANDREA PASCUCCI, WOLFGANG J. RUNGALDIER, *Financial Mathematics: Theory and Problems for Multi-period Models*, Springer, 2012.