

Dr. John Schoemakers

<http://www.wias-berlin.de/people/schoenma/?lang=0>



Im Wintersemester 2011/12 halte ich die Vorlesung

*Monte Carlo basierte Methoden in
der Finanzmathematik*

Inhalt:

Modellierung von Zinsen und Aktien, Libor-Zinsmodelle, Stochastische Volatilitätsmodelle, Bewertung von komplex strukturierten Finanzprodukten, Theorie des Optimalen Stoppens, Monte Carlo Methoden für hochdimensionale Stopp Probleme; Regressionsmethoden, Duale Methoden, Iterative Lösungsverfahren

Voraussetzungen:

Finanzmathematik I

Literatur:

P. Glasserman: Monte Carlo Methods in Financial Engineering,
siehe weiter <http://www.wias-berlin.de/people/schoenma/?lang=0>

Vorlesung:

Fr, 11 – 13 Uhr, RUD 25, Raum 1.114

Beginn: am 21. 10. 2011

Sprechstunden: nach Vereinbarung