



Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik)

Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz

 **Download**

 **Online Lesen**

Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung
(Studienbücher Wirtschaftsmathematik) Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz

[Belle]

 [Download Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und I
...pdf](#)

 [Read Online Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und
...pdf](#)

Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik)

Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz

Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz

[Belle]

Downloaden und kostenlos lesen Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz

407 Seiten

Werbetext

Finanzderivate mit praktischer Darstellung und Computerprogrammen Kurzbeschreibung

Grundlegende Begriffe wie fehlendes Arbitrage, fairer Preis, vollständiger Markt und Martingal werden anhand von einem Markt mit einem risikolosen Bond und einer Aktie definiert. Anschließend wird mit dem Übergang zum zeitstetigen Modell die Black-Scholes Formel für Optionen hergeleitet und die Faktoren zur praktischen Implementierung eingeführt. Methoden der stochastischen Analysis wie die Ito-Formel werden abgeleitet und der klassische Ansatz nach Black-Scholes mittels der stochastischen Differenzialgleichung präsentiert. Der Ansatz über die Martingaltheorie ist ein Gegenstand, der für die Bewertung komplexer Optionen (amerikanische und exotische) notwendig ist. Im letzten Kapitel sind die Grundlagen der Zinsstrukturmodelle Gegenstand der Betrachtung.

In allen Abschnitten werden numerische Methoden angegeben, die mit Programmen zur praktischen Illustration implementiert werden.

Buchrückseite

Grundlegende Begriffe wie fehlendes Arbitrage, fairer Preis, vollständiger Markt und Martingal werden anhand von einem Markt mit einem risikolosen Bond und einer Aktie definiert.

Anschließend wird mit dem Übergang zum zeitstetigen Modell die Black-Scholes Formel für Optionen hergeleitet und die Faktoren zur praktischen Implementierung eingeführt. Im umfangreichen dritten Kapitel werden Methoden der stochastischen Analysis wie die Ito-Formel abgeleitet und der klassische Ansatz nach Black-Scholes mittels der stochastischen Differenzialgleichung präsentiert.

Der Ansatz über die Martingaltheorie nach Kreps und Harrison ist der Gegenstand am Beginn des vierten Kapitels, was für die Bewertung komplexer Optionen (amerikanische und exotische) notwendig ist. Im letzten Kapitel sind die Grundlagen der Zinsstrukturmodelle Gegenstand der Betrachtung. Die Bewertung innerhalb der verschiedenen Ansätze (mittels Zinskurvenmodelle oder der Vorwärtsrate) wird diskutiert. In allen Abschnitten werden numerische Methoden angegeben, die mit Programmen zur praktischen Illustration implementiert werden.

Arbitragetheorie anhand von diskreten Finanzmodellen - Black-Scholes Theorie (Cox-Ross-Rubinstein Herleitung) - Zeitstetige Modelle und stochastische Differenzialgleichungen - Martingaltheorie - Amerikanische und exotische Optionen - Zinsstrukturmodelle - Numerische Methoden - Softwareimplementierung

- Studierende der Mathematik, Finanz- und Wirtschaftsmathematik bzw. Wirtschaftswissenschaften an Universitäten und Fachhochschulen

- Praktiker und Berufseinsteiger in der Finanzwirtschaft, insbesondere Praktiker mit Interesse an den theoretischen Grundlagen der Bewertung von Finanzderivaten

Prof. Dr. Georg Schlüchtermann, Mathematisches Institut, Ludwig-Maximilians-Universität München

Dr. Stefan Pilz, Mathematisches Institut, Ludwig-Maximilians-Universität München

Download and Read Online Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz #U380A4M2KIR

Lesen Sie Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) von Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz für online ebook
Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) von Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz Kostenlose PDF d0wnl0ad, Hörbücher, Bücher zu lesen, gute Bücher zu lesen, billige Bücher, gute Bücher, Online-Bücher, Bücher online, Buchbesprechungen epub, Bücher lesen online, Bücher online zu lesen, Online-Bibliothek, greatbooks zu lesen, PDF Beste Bücher zu lesen, Top-Bücher zu lesen
Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) von Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz Bücher online zu lesen.
Online
Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) von Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz ebook PDF herunterladen
Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) von Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz Doc
Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) von Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz
Mobipocket
Modellierung derivater Finanzinstrumente: Theorie und Implementierung (Studienbücher Wirtschaftsmathematik) von Georg Schlüchtermann, Stefan Pilz EPub