



Universität Hamburg
DER FORSCHUNG | DER LEHRE | DER BILDUNG

FAKULTÄT
FÜR MATHEMATIK, INFORMATIK
UND NATURWISSENSCHAFTEN

Fachbereich Mathematik

Kolloquium über Mathematische Statistik und Stochastische Prozesse

Prof. Dr. Jan Kallsen

Christian-Albrechts-Universität zu Kiel

13.11.2018, 16:15 Uhr, Hörsaal 5

Überraschende Einsichten und didaktische Anmerkungen zur Finanzmathematik

Abstract:

Der Vortrag wendet sich sowohl an diejenigen, die im weiteren Sinne finanzmathematische Inhalte in der Lehre vermitteln, als auch an interessierte Laien auf diesem Gebiet. Im ersten Teil geht es um einen mathematischen Rahmen, in dem Hauptergebnisse der Arbitrage-theorie (erster und zweiter Fundamentalsatz, Satz des einheitlichen Preises, Superhedgingtheorem) formuliert werden können, ohne den in der Literatur üblichen impliziten Inkonsistenzen zu unterliegen. Im zweiten Teil werden eine Reihe überraschender finanzmathematischer Resultate diskutiert, die durchaus alltagsrelevante Einsichten liefern und die dem gesunden Menschenverstand auf den ersten und mitunter auch den zweiten Blick zu widersprechen scheinen.

Prof. Dr. Jan Kallsen

Christian-Albrechts-Universität zu Kiel

<http://www.math.uni-kiel.de/finmath/de/personen/kallsen>

Kontakt:

Prof. Dr. Sören Christensen (<http://www.math.uni-hamburg.de/home/christensen/>)

Universität Hamburg