

1. Record Nr.	UNINA9910484266503321
Autore	Bäuerle Nicole
Titolo	Finanzmathematik in diskreter Zeit / / von Nicole Bäuerle, Ulrich Rieder
Pubbl/distr/stampa	Berlin, Heidelberg : , : Springer Berlin Heidelberg : , : Imprint : Springer Spektrum, , 2017
ISBN	3-662-53531-9
Edizione	[1st ed. 2017.]
Descrizione fisica	1 online resource (XIV, 238 S. 28 Abb.)
Collana	Masterclass
Disciplina	519
Soggetti	Economics, Mathematical Statistics Quantitative Finance Statistics for Business, Management, Economics, Finance, Insurance
Lingua di pubblicazione	Tedesco
Formato	Materiale a stampa
Livello bibliografico	Monografia
Nota di contenuto	Einführung und erste Beispiele -- Endliche Finanzmärkte -- Das Cox-Ross-Rubinstein Modell -- Arbitragefreiheit und Äquivalente Martingalmaße -- Vollständigkeit und Äquivalente Martingalmaße -- Risikoneutrale Bewertung von Zahlungsansprüchen -- Amerikanische Optionen -- Präferenzen -- Portfolio-Optimierung -- Erwartungswert-Varianz-Portfolios -- Risikomaße -- Anhang A: Hilfreiches aus der Stochastik -- Anhang B: Martingale und Stoppzeiten -- Anhang C: Lineare und konvexe Optimierung -- Lösungen der Übungsaufgaben -- Sachverzeichnis.
Sommario/riassunto	Dieses Lehrbuch bietet eine leicht verständliche Einführung in die moderne Finanzmathematik und erläutert grundlegende mathematische Konzepte der Optionsbewertung, der Portfolio-Optimierung und des Risikomanagements. Hierzu gehören die Preisbestimmung durch Arbitrageüberlegungen, die Preisbestimmung von amerikanischen Optionen über die Lösung optimaler Stopp-Probleme, die Bestimmung von optimalen Konsum- und Investitionsstrategien und Erwartungswert-Varianz Portfolios. Aktuelle Konzepte der Risikomessung wie Value at Risk und Expected Shortfall werden ebenso vorgestellt. Grundlagen in Stochastik und Optimierung reichen für das Verständnis der Inhalte aus, und zahlreiche

Übungsaufgaben mit ausführlichen Lösungen sowie drei Anhänge erleichtern das Selbststudium. Die Autoren Prof. Dr. Nicole Bäuerle, Institut für Stochastik, Karlsruher Institut für Technologie Prof. Dr. Ulrich Rieder, Institut für Optimierung und Operations Research, Universität Ulm.
