

1. Record Nr.	UNINA9910484621103321
Autore	Hoffmann Michael
Titolo	Stochastische Integration : Eine Einführung in die Finanzmathematik // von Michael Hoffmann
Pubbl/distr/stampa	Wiesbaden : , : Springer Fachmedien Wiesbaden : , : Imprint : Springer Spektrum, , 2016
ISBN	3-658-14132-8
Edizione	[1st ed. 2016.]
Descrizione fisica	1 online resource (XIII, 284 S.)
Collana	BestMasters, , 2625-3615
Disciplina	519.2
Soggetti	Probabilities Social sciences - Mathematics Computer science - Mathematics Probability Theory Mathematics in Business, Economics and Finance Mathematical Applications in Computer Science
Lingua di pubblicazione	Tedesco
Formato	Materiale a stampa
Livello bibliografico	Monografia
Nota di bibliografia	Includes bibliographical references.
Nota di contenuto	Pfadweise stochastische Integrale -- Stochastische Integration nach lokalen Martingalen und nach Semimartingalen -- Itô-Kalkül, stochastische Integraldarstellung -- Girsanov-Transformation, stochastische Differentialgleichungen -- Allgemeine Finanzmarktmodelle vom Black-Scholes-Typ und das Black-Scholes-Modell.
Sommario/riassunto	Michael Hoffmann stellt auf leicht verständliche Art und Weise die Grundlagen der stochastischen Analysis dar, d.h. die Begriffe der stochastischen Integration und der stochastischen Differentialgleichungen. Die gewonnene Theorie wird anschließend dazu verwendet, das verallgemeinerte Black-Scholes-Modell zu definieren. Es folgt eine Diskussion zu Arbitrage und der Bewertung von Finanzderivaten, ehe das klassische Black-Scholes-Modell als Spezialfall identifiziert wird. Das Werk ist besonders geeignet für Studenten, die einen leichten Einstieg in die theoretischen Grundlagen der Finanzmathematik gewinnen möchten. Der Inhalt Pfadweise stochastische Integrale Stochastische Integration nach lokalen

Martingale und nach Semimartingale Itô-Kalkül, stochastische
Integraldarstellung Girsanov-Transformation, stochastische
Differentialgleichungen Allgemeine Finanzmarktmodelle vom Black-
Scholes-Typ und das Black-Scholes-Modell Die Zielgruppen
Studierende und Lehrende der Mathematik bzw. Stochastik, besonders
der Fachgebiete Wahrscheinlichkeitstheorie und Finanzmathematik Der
Autor Michael Hoffmann arbeitet im Bereich der Statistik für
stochastische Prozesse. Er ist derzeit wissenschaftlicher Mitarbeiter am
Lehrstuhl für Stochastik der Ruhr-Universität Bochum.
