

Samstagsuniversität am 28. April 2012

Vortragender: Dipl.-Math. oec. Carsten Erdmann, Institut für Mathematik, Lehrstuhl für Angewandte Analysis

Titel: „Die Mathematik der Finanzkrise – Wie berechnet man eigentlich den fairen Preis von Finanztiteln?“

Am: 28. April 2012, um 11:00 Uhr im Großen Hörsaal der Physik (Universitätsplatz 3)

Kurz-Zusammenfassung:

Speziell in den letzten Jahren rückte im Zuge der Finanzkrise die Problematik der Bewertung von Finanztiteln in den Fokus der Öffentlichkeit. Zur Berechnung des Preises dieser teils sehr komplizierten Finanzkonstrukte werden mathematische Modelle benutzt. Der Vortrag soll auf verständliche Art und Weise zeigen, um welche Modelle es sich handelt und wie man diese benutzen kann um den 'fairen' Preis solcher Finanzprodukte zu berechnen. Dabei wird der Schwerpunkt auf sogenannte stochastische Volatilitätsmodelle, welche ein intuitives Verständnis der Herangehensweise ermöglichen, gelegt. Um einen möglichst verständlichen Einblick in die Problematik zu bekommen, beschränkt sich der Vortrag auf europäische Optionen. Dies sind sehr spezielle und eher einfach konstruierte Finanztitel, die auch an der Börse gehandelt werden.

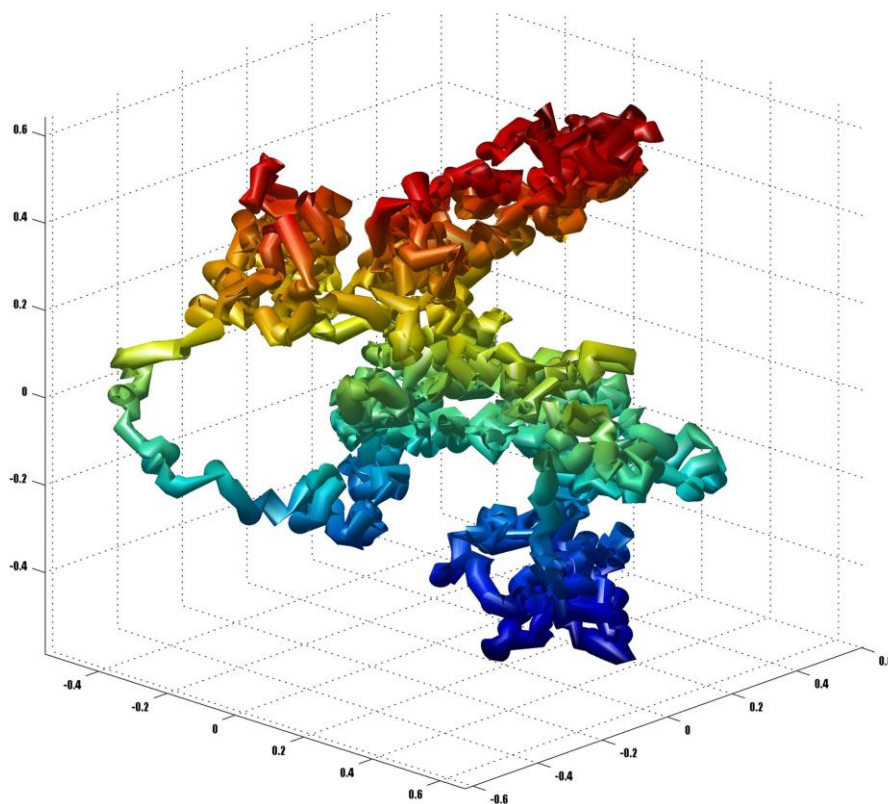


Abbildung: Die Modellierung des Zufalls.