Matematisk finansieringsteori, E99, ugeseddel \( \[ - \infty; 0 \] \)

Jeg

hedder Rolf Poulsen, er nyansat adjunkt på AFOR og skal underholde i Matematisk finansieringsteori. Jeg sidder på kontor E-411 (dvs. på 4. sal i E-bygningen), har telefon 353 20685 og email rolf@math.ku.dk

Lærebogen

bliver (og her har vi allerede den første deciderede afvigelse fra studieplanen) Tomas Björks bog \textit{Arbitrage Theory in Continuous Time} udgivet af Oxford University Press i 1998. Boghandlen her på stedet er blevet bedt om at tage bogen hjem, men desværre tyder meget på, at den er udsolgt fra forlaget. Man kan muligvis finde enkelte eksempler af boghandler eller på nettet (f.eks. \url{www.oup.co.uk} eller \url{www.amazon.co.uk}), men løsningen bliver sandsynligvis, at der udleveres kopier til forelæsningerne. Desuden kan det ikke afvises, at der vil blive udelaveret noget supplerende materiale i løbet af semesteret, men det er min mening at holde mig ganske tæt op til bogen.

Hvem kan deltage i kurset?

Kurset udbydes, som der står i studieordningen, til studerende ved Institut for Matematiske fag, dvs. det henvender sig primært til Mat-Øk'er. Men Björks bog er meget pædagogisk, kræver minimale forudsætninger og nedtoner en del tekniske aspekter, så det skulle bestemt være muligt for polit'er eller andre opvakte perosner at følge med. Om man har husket at forhåndstilmelde sig er også ganske ligegyldigt.

En hjemmeside for kurset kan man finde på \url{http://www.math.ku.dk/~rolf/mfe99.html}

Foredragstrin

ligger mandage 12-14 i aud. 8 samt fredage 12-14 i aud. 10.
Vi iber dog straks med undtagelser: Fredag den 3. sep. flytter vi til aud. 3 pga. et PhD-forsvar og fredag den 17. sep. aflyser vi pga. et PhD-forsvar (mit).

Kommende foredragstrin.

Efter overståelse af indledende højheder, går vi igang med kap. 1 (snak) og 2 (en- og fler-periode binomial modeller, der vil være nogle af tilhørene bekendt). Det skulle vi så godt og vel have overstået ved udgangen af den første uge. Herfter skifter scenen tilsyneladende totalt, og vha. kap. 3 og 4 vil vi introducere vigtige dele af teorien om stokastisk integration. \textit{Det} kunne
man godt forestille sig tog et par uger.

**Hvordan får man point for kurset?**

Der er tre betingelser:

a) Der stilles $n$ opgavesæt til aflevering (sandsynligvis $n = 4$), hvoraf mindst 60% af den samlede opgavemasse skal besvares korrekt. Disse opgaver skal holde jer til ilden uden at andrage urimelige proportioner.

b) Derefter stilles en praktisk, dvs. computer-orienteret, numerisk opgave. Den må man lave i ikke for store ($\leq 3$) grupper, og den skal afleveres til og godkendes af mig (hvilket den bliver hvis mindst 55-60 % er korrekt).

c) Sluttelig består man en 4-timers skriftlig eksamen med alle hjælpemidler og karakter, $k$, efter 13-skalaen. Dvs. der kræves $k \geq 6$, og $k$ er så løvrigt ens endelige karakter i kurset.

Vh

Rolf