

Vorlesung “Finanzmathematik” (TM/SRM/SM/MM)  
Block : Informationen

## Kontakt

apl. Professor Dr. Harald Löwe  
Technische Universität Braunschweig  
Institut Computational Mathematics  
AG Partielle Differentialgleichungen  
Raum F420, Pockelsstraße 14 (Forumsgebäude), 38 106 Braunschweig  
Das Forumsgebäude finden Sie zwischen AudiMax und Uni–Bibliothek  
Tel.: 0531–391/7401; EMail: h.loewe@tu-bs.de  
WWW–Seite zur Vorlesung: <http://finanzmathe.mathe-lok.de/>  
Sprechstunde: Jederzeit nach Vereinbarung.

## Literatur zur Vorlesung

Zunächst möchte ich einige Bücher aufführen, die Sie als Begleitung zur Vorlesung nehmen können. Suchen Sie sich dasjenige aus, mit dem *Sie* am besten leben können.

- [1.] Tietze, J.: Einführung in die Finanzmathematik. Vieweg 2003, ca. 25 €. Nach diesem Buch richtet sich der Hauptteil der Vorlesung mit Ausnahme des letzten Kapitels. Mit über 400 Seiten ist es zwar etwas dick, dafür aber auch sehr ausführlich und gut verständlich.
- [2.] Adelmeyer, M.; Warmuth, E.: Finanzmathematik für Einsteiger, Vieweg 2003, ca. 20 €. Ein wirklich gelungenes Buch für den Anfänger, das man auch als Schüler schon hätte lesen können. Behandelt werden Renditen, Versicherungen, Aktien, Portfolios und Optionen. Als Ergänzung zur Vorlesung kann ich Ihnen dieses Buch sehr empfehlen.
- [3.] Luderer, B.: Starthilfe Finanzmathematik, Teubner 2003, ca. 16 €. Sehr viel knapper gehalten als das Buch von Tietze wendet sich diese Starthilfe an diejenigen, die ohne großen Aufwand wenigstens die Grundzüge der klassischen Finanzmathematik lernen wollen.
- [4.] Caprano, E.; Wimmer, K.: Finanzmathematik, Verlag Vahlen 1999, ca. 17 €. Noch ein sehr knapp gehaltenes Buch, das aber ebenfalls gut verständlich ist.

- [5.] Grundmann, W.; Luderer, B.: Formelsammlung — Finanzmathematik, Versicherungsmathematik, Wertpapieranalyse, Teubner 2001, ca. 19 €.

Wenn Sie Formelsammlungen schätzen — hier ist eine. Beachten Sie aber bitte, daß allein der Besitz einer Formelsammlung in der Klausur nicht sehr nützlich ist.

Falls Sie sich zwangsweise oder interessehalber mit Optionen, Finanzderivaten oder Portfolio-Optimierung beschäftigen, sollten Sie einen Blick auf die nächsten Bücher werfen. Diese gehen weit über den Umfang der Vorlesung hinaus und verwenden tiefergehende mathematische Methoden, die allerdings in sämtlichen Büchern liebevoll erklärt werden.

- [6.] Hausmann, W.; Diener, K.; Käsler, J.: Derivate, Arbitrage und Portfolio-Selection, Vieweg 2002, ca. 30 €.

Eine sehr umfassende Einführung in die Theorie der derivativen Finanzprodukte und der Risikosteuerung (Hedging). Es wird besondere Rücksicht auf Nicht-Mathematiker genommen.

- [7.] Korn, R.; Korn, E.: Optionsbewertung und Portfolio-Optimierung, Vieweg 2001, ca. 27 €.

Hier sollten Sie schon etwas Kenntnisse aus der Stochastik mitbringen, um dieses Buch mit (großem) Gewinn lesen zu können.

- [8.] Irle, A.: Finanzmathematik, Teubner 1998, ca. 20 €.

Ebenfalls eine gute Einführung in die Theorie der Derivate, die allerdings Kenntnisse aus der Stochastik voraussetzt.

- [9.] Günther, M.; Jüngel, A.: Finanzderivate mit MATLAB, Vieweg 2003, ca. 25 €.

In diesem Buch geht es um die Behandlung von Finanzderivaten mit der mathematischen Programmierumgebung MATLAB (kostenloser Ersatz: SciLAB). Falls Sie sich wirklich einmal um solche Dinge kümmern müssen, kann Ihnen dieses Buch viel Entwicklungszeit abnehmen.