MATEMATIK OCH OPTIONER (CTH[TMA861]&GU[MAN690])

SCHEMA OCH TENTAMENSTIDER VT 00

Lärare: Christer Borell (CB) och Anders Öhgren (AÖ)

Vecka	Dag	Datum	Tid	Sal	Lärare	Inlämning
3	Må	17 jan	$13^{15}-15$	MD6	CB	
	Fr	21 jan	8-10	MD6	CB	
4	Må	24 jan	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	On	26 jan	$13^{15}-15$	MD7	AÖ	
	Fr	28 jan	8-10	MD6	CB	Uppgift 1
5	On	2 feb	$13^{15}-15$	MD7	AÖ	
	Fr	4 feb	8-10	MD6	CB	
6	Må	7 feb	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	Fr	11 feb	13^{15}-15	MD8	CB	Uppgift 2
7	Må	14 feb	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	On	16 feb	$13^{15}-15$	MD7	AÖ	
	Fr	18 feb	8-10	MD6	CB	
8	Må	21 feb	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	On	23 feb	$13^{15}-15$	MD7	AÖ	
	Fr	25 feb	8-10	MD6	CB	Uppgift 3
9	Må	28 feb	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	On	1 mar	$13^{15}-15$	MD7	AÖ	
	Fr	3 mar	8-10	MD6	CB	
11	Må	13 mar	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	On	15 mar	$15^{15}-17$	MD7	AÖ	
	Fr	17 mar	8-10	MD7	CB	Uppgift 4
12	Må	20 mar	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	Fr	24 mar	8-10	MD7	CB	
13	Må	27 mar	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	Fr	31 mar	8-10	MD7	CB	Uppgift 5
14	Må	3 apr	$13^{15}-15$	MD7	CB	
	Fr	7 apr	8-10	MD7	CB	
15	On	12 apr	$15^{15}-17$	MD7	CB	Uppgift 6
	Lö	15 apr	$8^{45}-13^{45}$	MG, tent.		
19	Lö	13 maj	$8^{45}-13^{45}$	VV, omtent.		

PRELIMINÄR GENOMGÅNG AV KURSEN

Dominansprincipen (vecka 3)
Binomialmetoden (vecka 4: må, fre; vecka 5: fre)
Konvexitet (vecka 5: on; vecka 7: on (ej hela tiden))
Brownsk rörelse och värmeledningsekvationen (vecka 6, vecka 7: må, fre)
Black-Scholes differentialekvation (vecka 8; må, fre; vecka 9: må)
Måtteori (vecka 9: fre; vecka 11: må, fre 17)
Utdelningar (vecka 11: on)
Stokastiska grundbegrepp (vecka 12: må)
Paley-Wieners integral (vecka 12: fre)
Wienermått och translation (vecka 13: må)
Itôintegraler (vecka 13: fre ; vecka 14)
Självfinansierande portföljstrategier (vecka 15: on)

De onsdagslektioner som ej har ett teoretiskt program ägnas åt räkneövning.