



Angewandte Mathematik  
Institut für Mathematik der Universität Zürich  
Winterthurerstrasse 190, CH-8057 Zürich  
Tel. +41-1-635 58 31, Fax +41-1-635 57 05

### Vorlesungsbestätigung

Herr Dr. Christof Luchsinger, Zürich, hat im Wintersemester 1999/2000 an der Abteilung Angewandte Mathematik der Universität Zürich die 4 stündige Vorlesung (plus 2 Stunden Übungen)

#### Einführung in die Finanzmathematik

gelesen. Der abgedeckte Stoff beinhaltet

- Portfoliomanagement (Mean Variance, CAPM)
- Modelle in diskreter Zeit
- Modelle in stetiger Zeit
- Zeitreihenanalyse (inklusive ARCH, GARCH)

Herr Luchsinger hat dazu auch eigens ein ausführliches Skript verfasst. Der Dozent vermochte eine grosse Zahl von StudentInnen anzuziehen, manche liessen sich auch in diesem Fach bei ihm prüfen. Er hat die Vorlesung mit grosser Motivation, didaktischem Geschick und fachlicher Kompetenz gehalten.

Zürich, den 3. März 2000

Prof. Dr. A.D. Barbour