



Leipziger Gespräche zur Mathematik



Prof. Dr. Hans Föllmer

Professor em. für Stochastik und Finanzmathematik
Humboldt-Universität zu Berlin

Zufall und Kalkül

Wie rechnet man mit Kurven, die so erratisch sind wie die Brown'sche Molekularbewegung oder die Preisschwankung einer Aktie? Zwei junge Mathematiker, Kiyosi Itô und Wolfgang Döblin, Sohn des Schriftstellers Alfred Döblin, gaben vor knapp 70 Jahren zwei verschiedene Antworten. Die eine spielt als Ito-Kalkül seit langem eine zentrale Rolle, nicht nur innerhalb der Mathematik, sondern auch in vielen Anwendungsgebieten, zum Beispiel auf den Finanzmärkten. Die andere lag 60 Jahre lang in einem versiegelten Umschlag in den Archiven der Pariser Académie des sciences. Wir schildern beide und gehen auch auf die Frage ein, welche Rolle der stochastische Kalkül auf den Finanzmärkten spielt.

Hans Föllmer studierte Mathematik, Philosophie und Physik an den Universitäten Köln, Göttingen, Paris und Erlangen. Nach mehreren Jahren als Postdoc in den USA war er Professor für Mathematik bzw. für Statistik in Frankfurt, Bonn, an der ETH Zürich und seit 1994 an der Humboldt-Universität zu Berlin. Er ist Ehrendoktor der Universität Paris-Dauphine, Andrew D. White Professor-at-Large an der Cornell University und Mitglied der Nationalen Akademie der Wissenschaften Leopoldina, der Berlin-Brandenburgischen Akademie der Wissenschaften und der Academia Europaea.

Mittwoch, 27. Januar 2010, 19:00 Uhr, Alte Handelsbörse

EINLADENDE: Die Stadt Leipzig in Zusammenarbeit mit dem Mathematischen Institut der Universität Leipzig und dem Max-Planck-Institut für Mathematik in den Naturwissenschaften Leipzig.



UNIVERSITÄT LEIPZIG



MAX-PLANCK-GESELLSCHAFT