

# Eksamen i Stokastiske Differentialligninger II

## Pensum for F 2011

**Pensum:** B. Øksendal, 6. udgave (sidste), Stochastic Differential Equations, siderne 143–144, 159–168, 175–177, 183, 205–222, 224–228, 261–298.

Noter om bogens eksempel 10.2.2, 5 sider.

Nogle bemærkninger om Girsanovs sætning, 7 sider.

Noter om Snellhylstret, siderne 111–113, 32–40.

### Spørgsmål til den mundtlige eksamen:

1. Feynman–Kac' sætning.
2. Girsanovs sætninger.
3. Øksendals eksempel 10.2.2: When is the right time to sell the stocks.
4. Eksistens og entydighed af optimal stoptid.
5. Komplette markeder og europæiske optioner.
6. Komplette markeder og amerikanske optioner.
7. Snellhylstret.