

2008:16

Självständigt arbete i matematik

Matematiska institutionen

Stockholms universitet

Gustav Lindqvist: En ung mans portföljval: deterministisk och osäker optimering av nytta under en livstid

Handledare: Jan-Erik Björk

Sammanfattning

Syftet med detta examensarbete är att visa hur en ung man kan göra ett optimalt portföljval då det råder osäkerhet kring avkastningen på det finansiella instrumentet. Problemet löses genom dynamisk optimering. Vidare kommer examensarbetet att med hjälp av numeriska lösningar ytterligare bidra till förståelsen av lösningen av problemet.