

Betriebswirtschaftliche Forschungsergebnisse

---

Band 127

# Optionspreise und optimale Portfolios auf unvollständigen Kapitalmärkten

Von

Alois Paul Knobloch



Duncker & Humblot · Berlin

ALOIS PAUL KNOBLOCH

Optionspreise und optimale Portfolios  
auf unvollständigen Kapitalmärkten

# Betriebswirtschaftliche Forschungsergebnisse

*Begründet von*

Professor Dr. Dr. h. c. mult. Erich Kosiol (1899 – 1990)

*Fortgeführt von dessen Schülerkreis*

*Herausgegeben von*

**Prof. Dr. Ernst Troßmann**  
Universität Hohenheim

*in Gemeinschaft mit*

**Professor Dr. Oskar Grün**  
Wirtschaftsuniversität Wien

**Professor Dr. Wilfried Krüger**  
Justus-Liebig-Universität Gießen

**Professor Dr. Hans-Ulrich Küpper**  
Ludwig-Maximilians-Universität München

**Professor Dr. Gerhard Schewe**  
Westfälische Wilhelms-Universität Münster

**Professor Dr. Axel von Werder**  
Technische Universität Berlin

**Band 127**