

Prof. Dr. H. Luschgy

Seminarankündigung für WS 2006/07 Risikomaße (Math Finance)

Zeit: Di 16 – 18

Das Risikomanagement ist besonders für Unternehmen aus dem Versicherungs- und Bankenbereich wichtig. Nach der Änderung der rechtlichen Rahmenbedingungen für Kreditrisiken (Basel II) und die Solvabilitätsbestimmung (Solvency II) wird in Betracht gezogen, bestimmte Risikomaße vorzuschreiben. Im Seminar soll die mathematische Theorie der Risikomaße diskutiert werden.

Das Seminar basiert u.a. auf ausgewählten Kapiteln in

Föllmer, H, Schied, A. (2004). Stochastic Finance, Second Edition. De Gruyter.

Kenntnisse der Wahrscheinlichkeitstheorie I, II werden vorausgesetzt. Für einige Passagen sind Kenntnisse über zeitdiskrete Finanzmarktmodelle hilfreich (die in der Vorlesung „Stochastische Prozesse I“ im WS 06/07 erworben werden können).

Interessenten mögen sich bitte bei mir (oder Frau Elenz, Zi. E 209) melden. Eine Vorbesprechung findet am

Dienstag, 25.07.2006, 14.15 Uhr im E 10

statt.