

Versicherungs- und Finanzmathematik

LUH Kolloquium

Im Forschungskolloquium des Leibniz Lab of Insurance and Financial Mathematics und des Instituts für Mathematische Stochastik tragen Wissenschaftler und Praktiker über aktuelle Themen aus dem Bereich Versicherungs- und Finanzmathematik vor. Das Kolloquium richtet sich gleichermaßen an Studierende und Wissenschaftler sowie Praktiker und bietet ein Forum für den Austausch zwischen Wissenschaft und Wirtschaft.

Zeit:

Mittwoch, 7.07.2010
16.00 - 17.00 Uhr

Ort:

Institut für Mathematische Stochastik
Leibniz Universität Hannover
Welfengarten 1
30167 Hannover
Hörsaal F107



Organisation:

Prof. Dr. Ludwig Baringhaus
Prof. Dr. Rudolf Grübel
Prof. Dr. Stefan Weber
Dr. Thomas Knispel

Kontakt:

Dr. Thomas Knispel
knispel@stochastik.uni-hannover.de
Tel.: 0511/762 4249

Nächster Vortrag:

Prof. Dr. Holger Drees (Universität Hamburg)

spricht zum Thema

Extremale Abhängigkeiten bei Zeitreihen

Inhalt: Wir betrachten Zeitreihen von (Tages-)Renditen einer Geldanlage. Um das mit dem Investment verbundene Risiko großer Verluste richtig einschätzen zu können, reicht es nicht aus, die Tails der Renditeverteilung zu analysieren. Treten nämlich große Verluste verstärkt in Clustern auf, dann besteht die Gefahr, dass diese sich zu extremen Verlusten akkumulieren.

Da es unklar ist, ob die gängigen Modelle für Renditezeitreihen (wie etwa Modelle vom GARCH-Typ oder Modelle mit stochastischer Volatilität) die extremale Abhängigkeitsstruktur korrekt beschreiben, werden ergänzend statistische Verfahren zur Analyse des Extremwertverhaltens benötigt, die unter schwachen strukturellen Annahmen zuverlässige Schätzungen von das Extremwertverhalten beschreibenden Größen erlauben. In dem Vortrag wird am Beispiel des sog. Extremalindex, der den mittleren asymptotischen Clusterumfang angibt, demonstriert, wie das asymptotische Verhalten derartiger Schätzer mit Hilfe empirischer Prozesse untersucht werden kann. Da die sog. Blockschätzer für den Extremalindex bekanntermaßen oft so stark verzerrt sind, dass sie in der Praxis kaum anwendbar sind, wird besondere Betonung auf einen Ansatz zur Biasreduktion gelegt.

Interessenten sind herzlich eingeladen !

Ab 15.30 Uhr findet im Raum F 448 ein Empfang bei Kaffee und Gebäck statt.

Weitere Informationen zum Kolloquium und zur Anfahrt:

www.stochastik.uni-hannover.de

Weitere Informationen zum Leibniz Lab:

www.leibniz-lab.de

Versicherungs- und Finanzmathematik

Vorträge im Sommersemester 2010

- 22.04.2010 **Dr. Stefan Jaschke**
(Munich Re)
- 07.05.2010 **Prof. Dr. Axel Munk**
(Georg-August-Universität Göttingen)
- 07.05.2010 **Prof. Dr. Markus Reiß**
(Humboldt-Universität zu Berlin)
- 03.06.2010 **Prof. Dr. Moritz Kaßmann**
(Universität Bielefeld)
- 17.06.2010 **Prof. Dr. Christian Hipp**
(Universität Karlsruhe)
- 07.07.2010 **Prof. Dr. Holger Drees**
(Universität Hamburg)
- 08.07.2010 **Prof. Dr. Michael Kupper**
(Humboldt-Universität zu Berlin)

Interessenten sind herzlich eingeladen !

Weitere Informationen zu den Vorträgen:

www.stochastik.uni-hannover.de