

Seminarankündigung für das WiSe 2011/12

Versicherungs- und Finanzmathematik

Inhalt:

Das Seminar behandelt ausgewählte Kapitel der Versicherungs- und Finanzmathematik und dient zur Vertiefung der Vorlesungsinhalte. Zu den Schwerpunkten zählen u. a.:

- Risikomessung und effiziente Implementierung von Risikomaßen
- Bewertung und Absicherung von Kreditderivaten
- High Frequency Trading
- Schätzung von Spätschäden
- Modellierung der Langlebigkeit (Longevity Risk)
- Market-consistent Embedded Value (MCEV)

Das Seminar richtet sich insbesondere an Studierende, die beabsichtigen, eine Bachelor- oder Masterarbeit im Bereich Versicherungs- und Finanzmathematik zu schreiben.

Zeit:

montags, 12 – 14 Uhr

Vorkenntnisse:

Die Teilnahme am Seminar setzt **solides** Wissen im Bereich der Stochastik, etwa im Umfang der Vorlesungen *Stochastik I* und *Stochastik II*, sowie Kenntnisse aus versicherungs- und finanzmathematischen Vorlesungen voraus.

Kontakt:

Für Fragen zu möglichen Seminarthemen und zur Organisation wenden Sie sich bitte an Thomas Knispel (Raum F450, knispel@stochastik.uni-hannover.de).