

Seminarankündigung für das WiSe 2012/13

Versicherungs- und Finanzmathematik

SE 2 Mi 12 – 14 Uhr F 448

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 Zins- und Kreditderivaten
- Portfoliooptimierung
- Prognose von Spätschäden und Reserven
- 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.

Vorbesprechung:

Die Vorbesprechung findet am Mittwoch, dem 17.10.2012, um 13.30 Uhr in Raum F 448 statt.

Vorkenntnisse:

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