

Bachelorarbeiten

1.1 Voraussetzungen für Bachelorarbeiten

Benötigte Vorlesungen	Grundvorlesungen, Kenntnisse in Wahrscheinlichkeitstheorie, mindestens eine Vorlesung Finanz- und/oder Versicherungsmathematik
-----------------------	--

Seminar am Lehrstuhl benötigt: Ja

Seminar im vierten Semester möglich: Ja

Abweichungen nach Absprachen mit dem Professor möglich.

1.2 Beispiel –Themen:

- Value at Risk und Expected Shortfall für Bondportfolios
- Konvergenzarbitrage am Beispiel von LTCM und Eurobonds
- Mehrperiodisches Markowitzmodell
- Zum Langlebigkeitsrisiko: Modellierung von Trends bei Sterbetafeln

Programmieren /Implementieren wichtig: in etwa 50% der Arbeiten sind

Programmierkenntnisse erforderlich

1.3 Themenvergabe:

In Absprache mit dem Dozenten, es besteht auch die Möglichkeit, Themen vorzuschlagen.