

Themenliste Hauptseminar im SS 2012

Liebe Studierende,

in diesem Semester lautet das Leitthema des Seminars:

„Monte Carlo Methods in Finance and Insurance“.

Die **verbindliche Anmeldung** mit Angabe von drei Wunschthemen und **Einreichung eines aktuellen Notenspiegels** erfolgt von Dienstag, 08.05., bis Freitag, 11.05.2012, jeweils von 12:15 bis 16:00 Uhr im Sekretariat. Die einzelnen Themen lauten:

1. Modelling Processes with Jumps
2. Discretization Methods
3. Pricing American Options
4. Methods for Increasing the Efficiency of Simulations
5. Estimating Sensitivities of Option Prices
6. Calculation of Risk Measures