

**JProf. Dr. Christoph Kühn**

Finanzmathematisches Seminar im WS 2007/2008

## **Risikothorie und Risikomanagement**

**Zeit: Dienstag, 14.00 – 16.00 Uhr**

**Ort: Raum 711 groß, Robert-Mayer-Straße 10**

### **Voraussetzungen / Organisatorisches:**

Kenntnisse im Umfang der Vorlesungen "Stochastische Prozesse" und "Einführung in die stochastische Finanzmathematik"

### **Vorbesprechung: Mo, 16.7. 13:55, Raum 110.**

Wer zu dem Termin nicht kommen kann, aber trotzdem einen Vortrag halten möchte, möge sich bitte mit mir ([ckuehn@math.uni-frankfurt.de](mailto:ckuehn@math.uni-frankfurt.de)) in Verbindung setzen.

### **Inhalt:**

In diesem Seminar werden wir uns mit der mathematischen Beschreibung und Handhabung finanzieller Risiken beschäftigen. Insbesondere werden Kredit-Risikomodelle, Copulas, das kollektive Risikomodell in der Versicherungsmathematik und das Ruinproblem für Versicherungsgesellschaften behandelt.

Bei besonderem Interesse können jedoch auch Themen aus anderen Bereichen der Finanzmathematik vergeben werden.

### **Literatur:**

A. J. McNeil, R. Frey, P. Embrechts (2005)  
Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques, and Tools  
Princeton University Press

T. Rolski, H. Schmidli, V. Schmidt, J. Teugels (1999)  
Stochastic Processes for Insurance and Finance, Wiley

Originalarbeiten

JProf. Dr. Christoph Kühn

Email an: [ckuehn@uni-frankfurt.de](mailto:ckuehn@uni-frankfurt.de)

Tel.: (069) 798-23357

Robert-Mayer-Str. 10, Raum 816