

Die Bewertung von temperaturbasierten Wetterderivaten



Filesize: 5.47 MB

Reviews

Very useful to all of class of people. It is really simplified but unexpected situations within the 50 % in the ebook. I am delighted to let you know that this is actually the best book i have read in my personal daily life and can be he finest ebook for at any time.
(Gwen Schultz)

DIE BEWERTUNG VON TEMPERATURBASIERTEN WETTERDERIVATEN

[DOWNLOAD](#)

To download **Die Bewertung von temperaturbasierten Wetterderivaten** PDF, you should click the link beneath and download the ebook or have access to additional information which are have conjunction with DIE BEWERTUNG VON TEMPERATURBASIERTEN WETTERDERIVATEN ebook.

Bachelor & Master Publishing, 2013. Taschenbuch. Condition: Neu. Neu Neuware; original eingeschweisst; Rechnung mit MwSt.; new item, still sealed; - Wetterderivate basieren auf nicht handelbaren Underlyings wie die Temperatur und haben einen unvollständigen Markt. Aufgrund dieser Besonderheiten kommt es zu einem Problem bei der Bewertung. Es wurden bisher viele Modelle vorgeschlagen, es existiert jedoch kein einheitlicher Ansatz. Diese Arbeit versucht, die Bewertung anhand des bekannten Modells von Alaton, Djehiche und Stillberger (2002) darzustellen. Um die Bewertung durchführen zu können, wird die Temperatur unter einem Ornstein-Uhlenbeck-Prozess mit einer Brownschen Bewegung modelliert, wodurch die Temperatureigenschaften bestimmt werden können. Die Bewertung erfolgt risikoneutral und der Preis einer HDD-Option wird dabei unter einem Martingalmaß bestimmt. Bei CDD-Optionen erfolgt die Preisbildung mithilfe einer Monte-Carlo-Simulation. Außerdem muss das Modell an den tatsächlichen Markt angepasst werden, wo der Marktpreis des Risikos ins Spiel kommt. Dieser Wert wird im risikoneutralen Modell als konstant angenommen. Es wird aber auch gezeigt, dass in der realen Welt diese Annahme nicht praktikierbar ist, was insbesondere anhand von weiteren Ansätzen deutlich wird. 56 pp. Deutsch.

[Read Die Bewertung von temperaturbasierten Wetterderivaten Online](#)[Download PDF Die Bewertung von temperaturbasierten Wetterderivaten](#)

Related Books



[PDF] **Rasskaz-Kanonizatsiya (The Story Canonisation): Unconventional Russian Language Textbook (Russian Reader): V Pomosh Izuchayushim Russkiy Yazik (Dlya Teh, Kto Eshe Zhiv): For Learners of the Russian Language (for Those Who are Still Alive)**

Click the web link listed below to download and read "Rasskaz-Kanonizatsiya (The Story Canonisation): Unconventional Russian Language Textbook (Russian Reader): V Pomosh Izuchayushim Russkiy Yazik (Dlya Teh, Kto Eshe Zhiv): For Learners of the Russian Language (for Those Who are Still Alive)" document.

[Save eBook »](#)



[PDF] **The Bazaar of Bad Dreams. Basar der bösen Träume, englische Ausgabe**

Click the web link listed below to download and read "The Bazaar of Bad Dreams. Basar der bösen Träume, englische Ausgabe" document.

[Save eBook »](#)



[PDF] **Studyguide for Constructive Guidance and Discipline: Preschool and Primary Education by Marjorie V. Fields ISBN: 9780136035930**

Click the web link listed below to download and read "Studyguide for Constructive Guidance and Discipline: Preschool and Primary Education by Marjorie V. Fields ISBN: 9780136035930" document.

[Save eBook »](#)



[PDF] **Stories from East High: Bonjour, Wildcats v. 12**

Click the web link listed below to download and read "Stories from East High: Bonjour, Wildcats v. 12" document.

[Save eBook »](#)



[PDF] **Sulk: Kind of Strength Comes from Madness v. 3**

Click the web link listed below to download and read "Sulk: Kind of Strength Comes from Madness v. 3" document.

[Save eBook »](#)



[PDF] **Portrait of a Marriage: V. Sackville-West and Harold Nicolson**

Click the web link listed below to download and read "Portrait of a Marriage: V. Sackville-West and Harold Nicolson" document.

[Save eBook »](#)