

Seminar Stochastische Prozesse

Bitte holen Sie sich die Kopie des von Ihnen zu bearbeitenden Textes bis zum **Freitag, den 27.7.2007** im Sekretariat bei Frau Regelin (Zi. 231) ab. Ansonsten geben wir das Thema weiter.

Nr.	Datum	Name	Betreuer	Thema
1	24.10.2007	F. Oser	Mundt	Jackson- und Whittle-Netzwerke
2	31.10.2007	Q. Cui	Mundt	Reversible Netzwerkprozesse
3	07.11.2007	H. Kudicke	Mundt	Die erweiterte Lévy-Formel mit Anwendungen auf Netzwerke
4	14.11.2007	T. Fucik	Bäuerle	Zufällige Poissonmaße
5	21.11.2007	T. Perkovic	Bäuerle	Lévyprozesse und zusammengesetzte Poissonprozesse
6	28.11.2007	E. Schüle	Bäuerle	Lévy-Itô Dekomposition
7	03.12.2007	S. Zeltmann	Bäuerle	Pfad- und Verteilungseigenschaften von Lévyprozessen
8	05.12.2007	A. Weiler	Mundt	Das Invarianzprinzip von Donsker
9	12.12.2007	Y.H. Si	Mundt	Ruintheorie für ein Unternehmen mit Kreditrisiko
10	19.12.2007	V. Khmil	Mundt	Ein Bayesscher adaptiver Kontrollansatz zum Risikomanagement in einem Binomialmodell
11	09.01.2008	N. Dietenmeier	Mundt	Strategien zur Minimierung des Shortfall Risikos im Binomialmodell: Charakterisierung und Konvergenz
12	16.01.2008	B. Sum	Bäuerle	Portfolio-Optimierung unter Transaktionskosten im CRR-Modell
13	23.01.2008	S. Goranova	Bäuerle	Optimale Investmententscheidungen mit exponentieller Nutzenfunktion
14	30.01.2008	F. Brandt	Bäuerle	Portfolio-Strukturierung mit Regime-Switching in diskreter Zeit
15	13.02.2008	L. Jeuter	Bäuerle	Gesteuerte Diffusionsmodelle für optimale Dividendenzahlungen

Anforderungen: Erstellung eines getippten Handouts (max. 3 Seiten), maximal 60minütiger Vortrag (egal ob Tafel, Folien, Beamer), Anwesenheit bei den übrigen Terminen.

Bitte setzen Sie sich rechtzeitig wegen Fragen und der inhaltlichen Abstimmung mit dem jeweiligen Betreuer in Verbindung. Das Handout sollten Sie uns spätestens **1 Woche** vor dem Vortragstermin zukommen lassen.