

## Die Bewertung von temperaturbasierten Wetterderivaten



Filesize: 4.45 MB

### **Reviews**

*Extremely helpful to any or all category of individuals. It really is rally fascinating throgh studying time period. I am just quickly could possibly get a pleasure of reading a composed ebook.*

*(Lawrence Keeling)*

## DIE BEWERTUNG VON TEMPERATURBASIERTEN WETTERDERIVATEN



To save **Die Bewertung von temperaturbasierten Wetterderivaten** PDF, you should refer to the link listed below and download the ebook or gain access to additional information which are related to 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](#)

## Relevant Kindle Books

---

**[PDF] Psychologisches Testverfahren**

Click the hyperlink below to download and read "Psychologisches Testverfahren" file.

[Save eBook](#)

»

---

**[PDF] Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs**

Click the hyperlink below to download and read "Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs" file.

[Save eBook](#)

»

---

**[PDF] Have You Locked the Castle Gate?**

Click the hyperlink below to download and read "Have You Locked the Castle Gate?" file.

[Save eBook](#)

»

---

**[PDF] The Java Tutorial (3rd Edition)**

Click the hyperlink below to download and read "The Java Tutorial (3rd Edition)" file.

[Save eBook](#)

»

---

**[PDF] Daycare Seen Through a Teacher s Eyes: A Guide for Teachers and Parents**

Click the hyperlink below to download and read "Daycare Seen Through a Teacher s Eyes: A Guide for Teachers and Parents" file.

[Save eBook](#)

»

---

**[PDF] Strengerer Datenschutz**

Click the hyperlink below to download and read "Strengerer Datenschutz" file.

[Save eBook](#)

»