

## Die Bewertung von temperaturbasierten Wetterderivaten



Filesize: 2.11 MB

### **Reviews**

*It is simple in study easier to fully grasp. It is definitely basic but unexpected situations within the fifty percent in the ebook. I am delighted to let you know that this is actually the finest publication i have got read inside my own life and could be he very best ebook for actually.*  
**(Destiny Walsh)**

## DIE BEWERTUNG VON TEMPERATURBASIERTEN WETTERDERIVATEN

[DOWNLOAD PDF](#)

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](#)

## Other eBooks



**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)**

Createspace, United States, 2015. Paperback. Book Condition: New. 216 x 90 mm. Language: Russian . Brand New Book. Here is my third Russian language textbook. For some reason, this book was much more difficult to...

[Download Book »](#)



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

Hodder & Stoughton Sep 2016, 2016. Taschenbuch. Book Condition: Neu. 178 mm. Neuware - A generous collection of thrilling stories - some brand new, some published in magazines, all entirely brilliant and assembled in one...

[Download Book »](#)



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

2009. Softcover. Book Condition: New. 5th. 8.25 x 11 in. Never HIGHLIGHT a Book Again! Includes all testable terms, concepts, persons, places, and events. Cram101 Just the FACTS101 studyguides gives all of the outlines, highlights,...

[Download Book »](#)



**Sea Pictures, Op. 37: Vocal Score**

Petrucci Library Press, United States, 2013. Paperback. Book Condition: New. 276 x 214 mm. Language: English . Brand New Book \*\*\*\*\* Print on Demand \*\*\*\*\*.Composed for the Norfolk and Norwich Festival, Sea Pictures was heard...

[Download Book »](#)



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

Parragon Book Service Ltd, 2009. Paperback. Book Condition: New. A new, unread, unused book in perfect condition with no missing or damaged pages. Shipped from UK. Orders will be dispatched within 48 hours of receiving...

[Download Book »](#)