

Jeg kan faktisk tilby følgende emner:

1. Modellering av røff stokastisk volatilitet i finans: konstruksjon av røff-sti-integral, simulering av røff volatilitet.
2. Rentemodellering: sammendrag av grunnleggende stokastiske rentemodeller, simulering av såkalte LIBOR-renter (se f.eks. Brigo, D., Mercurio, F.: Interest Rate Models- Theory & Practice. 2nd edition, Springer (2007).)
3. prising av rentegarantier i forbindelse med livsforsikring
4. Teori av risikomål i forbindelse med matematisk finans (sammendrag av grunnleggende teori)
5. "Asset liability management"-metoder i modern livsforsikring (basert på boken til Bühlmann)
6. "Quantitative risk management" basert på boken til McNeil, Frey, Embrechts (kap. 1, 2 (evt. kap. 3), beregning av konkrete eksempler.

Hilsen,

Frank