

Ökonometrie und Statistik für Financial Engineering

Prof. Stefan Mittnik, PhD & Prof. Dr. Göran Kauermann

Seminar im Sommersemester 2013

Nr.	Thema	Vortragende/r	Betreuer
B1	Univariate Renditeverteilungen	Schüller	Spanhel
B2	Lineare univariate Zeitreihenmodelle	Englmann	Spanhel
BM1	Resampling-Techniken	Shao	Yener
BM2	Multivariate Renditeverteilungen	Karpyn	Kauermann
BM3	Copulas	Pritzsche	Groll
BM4	Lineare Zeitreihenmodelle: Erweiterungen	Le	Fuest
BM5	GARCH-Modelle	Krezdorn	Spanhel
BM6	Portfolio-Management	Schneider	Yener
BM7	Capital Asset Pricing Model	Matheja	Yener
BM8	Faktormodelle und PCA	—	Groll
BM9	Risk Management	Andreeva	Groll
BM10	Nonparametrische Regression	Bauder	Kauermann
M1	GARCH-Modelle: Erweiterungen	Krause	Fuest
M2	Modellierung hochfrequenter Daten	Mayer	Fuest
M3	Bayesianische Konzepte im Financial Engineering I: Multivariate Verteilungen	Vogt	Kauermann
M4	Bayesianische Konzepte im Financial Engineering II: Zeitreihenmodelle	—	Kauermann

Termine

Das Seminar findet geblockt statt, und zwar vom *14.-15.06.2013* im BVS Bildungszentrum Holzhausen, Seeholzstraße 1-3, 86919 Utting am Ammersee.

Anforderungen

- Verfassen einer Seminararbeit (ca. 40000 bzw. 50000 Zeichen für Studierende im BA-/MA-Studiengang)
- Vortrag im Rahmen des Seminars (ca. 30 Minuten + Diskussion)
- Aktive Teilnahme am Seminar

Modus Operandi

- Binnen zwei Wochen nach der Themenvergabe sollten Sie sich ein erstes Mal mit Ihrem Betreuer treffen. Spätestens vier Wochen nach dem ersten Treffen ist eine Vorabversion der Seminararbeit beim Betreuer einzureichen, welche das Inhaltsverzeichnis sowie erste Inhalte umfasst.
- Abgabetermin der Seminararbeit ist *Sonntag, 09.06.2013, 24 Uhr*.

Hinweise zur Literatur

Zur Vorbereitung empfiehlt sich für alle Teilnehmer die Lektüre der Kapitel 1-4 aus [Ruppert \(2011\)](#). Das Buch ist aus dem LRZ-Netz via <http://ebooks.ub.uni-muenchen.de/28539/> frei herunterzuladen.

Eine Kopiervorlage der relevanten Kapitel aus [Tsay \(2013\)](#) sowie ggf. weitere Literatur zu einzelnen Themen wird von den Betreuern zur Verfügung gestellt.

Literatur

Ruppert, D. (2011). *Statistics and Data Analysis for Financial Engineering (Springer Texts in Statistics)*. New York: Springer.

Tsay, R. S. (2013). *An Introduction to Analysis of Financial Data with R*. Hoboken, New Jersey: Wiley.