

Simulationsmethoden in der Finanzmathematik

Lisa Kaltenböck, Wolfgang Stockinger

Johannes Kepler University

11. Februar 2018

- unbekannte Größe (z.B. hochdimensionales Integral) numerisch berechnen
- erzeugen "viele" mögliche unabhängige Zufalls-Szenarien und versuchen Rückschlüsse auf den exakten Wert der unbekanntes Größe zu ziehen

- deterministische Alternative zu MC-Methoden
- nach welchen Kriterien erzeugt man deterministische Szenarien
- besser/schlechter als MC-Methoden?

- Was sind Optionen?
- Wie kann man Optionen bewerten?
- Wozu braucht man (Q)MC-Methoden?