INSTITUT FÜR MATHEMATIK

FAKULTÄT FÜR MATHEMATIK, INFORMATIK UND PHYSIK

UNIVERSITÄT INNSBRUCK

Technikerstraße 13/7
A-6020 Innsbruck
Telefon: +43 512 507 6071 oder 6097

E-Mail: mathematik@uibk.ac.at
http://www.uibk.ac.at/mathematik/
Fax: +43 512 507 2920

SEMINARVORTRAG

Das Institut für Mathematik lädt zu folgendem Vortrag ein:

Friedrich Hubalek

Vienna University of Technology

Explicit variance-optimal hedging for processes with stationary and independent increments

In the first part of the talk we review some elements from the general theory of variance-optimal hedging and concrecte results in the case of univariate exponential random walk or Lévy models and simple payoffs, as exhibited in Hubalek/Kallsen/Krawczyk (2006).
In the second part we discuss extensions for multi-asset and path-dependent derivatives, possible with some trading restrictions.

Zeit: **Mittwoch, den 22. September 2010 um 14.15 Uhr**

Ort: **Victor-Franz-Hess Haus, Technikerstraße 25, HS G**

Gäste sind herzlich willkommen!

Christel & Stefan Geiß