FRIEDRICH-ALEXANDER UNIVERSITÄT ERLANGEN-NÜRNBERG
FACHBEREICH WIRTSCHAFTS-WISSENSCHAFTEN

LEHRSTUHL FÜR VOLKSWIRTSCHAFTSLEHRE,
INSB. WIRTSCHAFTSTHEORIE
Prof. Dr. Veronika Grimm

Master-Arbeit

zur Modellierung des Gas-Spotmarktes

in Kooperation mit der

Der Lehrstuhl für Wirtschaftstheorie, Prof. Dr. Grimm, bietet **in Kooperation mit der N-Ergie AG Nürnberg** eine Master-Arbeit zur Modellierung des Gas-Spotmarktes an.

Ziel der Arbeit ist die Weiterentwicklung der quantitativen Methoden für die Simulation der nicht absicherbaren Cash-Flows in der Lieferperiode sein:
Hierbei handelt es sich im Wesentlichen um die Modelle der Absatz- und Preissimulation in einer hohen Zeitauflösung. Die Entwicklung der gesamten Terminpreiskurve sollte in einem konsistenten mehr-Faktor-Modell modelliert werden, das im Stande ist, neben allgemeinen Parallelverschiebungen auch komplexere Strukturverschiebungen der Terminpreise abzubilden. Bei der Weiterentwicklung der Simulationsmodelle ist Wert darauf zu legen, dass Preis- und Absatzszenarien weiterhin konsistent zueinander über den gemeinsamen Risikofaktor "Temperatur" modelliert werden.

Beginn der Bearbeitung: baldmöglichst

Bei Interesse melden Sie sich bitte bei

Claudia Leepa ✉ claudia.leepa@ wiso.uni-erlangen.de ☎ 0911 / 5302-413