



INFORMATIK 2005 – Informatik LIVE!

35. Jahrestagung der Gesellschaft für Informatik | 19. bis 22.9.2005 | Uni Bonn

Symposium

Computational Finance

In der praktischen Umsetzung von Modellen in der Finanzindustrie (z. B. Bewertung von Finanzinstrumenten, Optimierung von Portfolios, Messung von Marktpreis- bzw. Kreditrisiken), zeigt sich immer stärker, dass neben einer traditionellen mathematischen Ausrichtung und neben klassischen informatischen Themengebieten (z. B. der Berechnungskomplexität von einzusetzenden Modellen) neue quantitative Aspekte z. B. hinsichtlich der Produktflexibilität (Stabilität, Skalierbarkeit von Modellen) in den Vordergrund rücken.

Leitung: A. B. Cremers, J. Lüssem (U Bonn), A. May (TU Darmstadt)

Zeit und Ort: Donnerstag, 22.9.2005, 09:00 – 15:30 Uhr, Raum HS XI

Agenda

Sitzung 1 · 09:00 – 10:30 · Financial Modelling

- *Klassische Mean-Variance-Portfoliooptimierung in allgemeinen arbitragefreien Marktmodellen*
J. Kremer (RheinAhr Campus, FH Koblenz)
- *Dynamic Coherent Risk Measures*
F. Riedel (U Bonn)
- *The Heston Model and the Smile*
U. Wystup (HfB, Frankfurt a. M.)

Sitzung 2 · 11:00 – 12:30 · Implementing Financial Models

- *Korrelationen in lückenhaften Daten*
U. Jaekel (NEC CCRLE, Sankt Augustin)
- *Portfolio-Optimierung unter Berücksichtigung von Modellunsicherheit*
J. Schumacher (U Bonn und NEC CCRLE, Sankt Augustin)
- *Praxisaspekte der Preisrechner-Anbindung am Beispiel von SAP-SEM*
R. Merkt (ifb AG, Köln)

Sitzung 3 · 14:00 – 15:30 · Asset Liability Management

- *Fair Value Revolution for Insurance – Opportunities and Limitations*
J. Seigner (Allianz AG, München)
- *Stochastic Simulation for prospective reserves*
A. May (TU Darmstadt)
- *Diskussion zum Thema „Trends in der Produktentwicklung“*