



INFORMATIK 2005 – Informatik LIVE!

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

Symposium

Computational Finance

22.09.2005

Bonn

Motivation

In der praktischen Umsetzung von Modellen in der Finanzindustrie (z. B. bei der Bewertung von Finanzinstrumenten, der Optimierung von Portfolios, der Messung und Steuerung 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 informatische Aspekte z. B. hinsichtlich der Produktflexibilität (Stabilität, Skalierbarkeit von Modellen) in den Vordergrund rücken.

Dieses Symposium ist thematisch an der Schnittstelle von Informatik und Mathematik angesiedelt. Es soll dazu dienen aktuelle Forschungsarbeiten in diesem Bereich vorzustellen und neue Forschungsansätze zu diskutieren.

Themenbereiche

Die Vortragsbeiträge für das Symposium sollen unter anderem Themen aus den folgenden Bereichen der Computational Finance behandeln:

- **Financial Modelling:** Modellierung von Finanzmärkten, Kalibrierung von Modellen
- **Portfoliooptimierung:** Portfoliooptimierung, Asset Management / Hedge Fonds, RAPM (Risk Adjusted Performance Measures)
- **Derivatebewertung:** Bewertungsmodelle, Simulationsbasierte Bewertung, Mehrdimensionale Modelle, Partielle Differentialgleichungen
- **Grid Computing in Finance:** Anforderungen an Grid-Plattformen im Finanzbereich, Anwendungsbeispiele für Grid Computing

Beiträge

Bei den Vortragsbeiträgen kann es sich beispielsweise um

- Übersichtsbeiträge, die ein oder mehrere der Themen aufarbeiten und einführend darstellen,
- Beschreibungen laufender oder abgeschlossener Forschungsarbeiten oder
- Erfahrungsberichte aus der Praxis

handeln. Zur Auswahl der Vorträge bitten wir um die Einreichung von bis zu einseitigen Zusammenfassungen des Vortragsbeitrags. Die Zusammenfassungen sind bis zum 27.05.2005 per eMail an Jens Lüssem jens@informatik.uni-bonn.de zu schicken.

Termine

- Einreichung der Abstracts bis zum 27.05.2005.
- Benachrichtigung über die Annahme der Vorträge am 17.06.2005.

Für die Teilnahme am Symposium ist eine Anmeldung zur GI-Jahrestagung erforderlich. Weitere Informationen zur Anmeldung erhalten Sie über die Website der Informatik 2005 unter dem Link <http://www.informatik2005.de/>

Zeitlicher Ablauf des Symposiums

Das Symposium ist gegliedert in eine halbtägige Session von ca. 6 eingeladenen Vorträgen und eine weitere Session in der die akzeptierten Vorträge vorgestellt werden. Eingeladene und eingereichte Vorträge haben eine Dauer von 30 Minuten.

Symposiumsleitung

Prof. Dr. Armin B. Cremers, Universität Bonn

Dr. Jens Lüssem, Universität Bonn

Prof. Dr. Angelika May, TU Darmstadt