



Graz University of Technology

Kolloquium

Finanz- und Versicherungsmathematik

24. Mai 2013, TU Graz

Seminarraum 2 (Geometrie),
Kopernikusgasse 24, 4.Obergeschoß

- 10.30 Uhr** **Eröffnung** durch Univ.-Prof. Dr. Robert Tichy
- 10.45 Uhr** **Univ.-Prof. Dr. Gerhard Larcher** (JKU Linz)
Analysis of Option-Trading-Strategies
- 11.30 Uhr** *Kaffeepause*
- 11.45 Uhr** **Privatdoz. Dr. Stefan Gerhold** (TU Wien)
Portfoliooptimierung unter Transaktionskosten
- 12.30 Uhr** *Mittagspause*
- 15.00 Uhr** *Kaffeepause*
- 15.15 Uhr** **Ao. Univ.-Prof. Dr. Friedrich Hubalek** (TU Wien)
Über einige finanzmathematische und ökonometrische Aspekte
der stochastischen Volatilitätsmodelle von Barndorff-Nielsen
und Shephard
- 16.00 Uhr** **DI Markus Zahrnhofer** (Merkur Versicherung AG, Graz)
Die Herausforderung von “Marktvolatilität“ in einem
marktkonsistenten Umfeld
- 16.45 Uhr** *Ende*

Hofer, Tichy