



UNIVERSITÄT
BAYREUTH

Universität Bayreuth • 95440 Bayreuth

**DEKAN DER FAKULTÄT FÜR
MATHEMATIK, PHYSIK UND
INFORMATIK**

PROF. DR. VOLKER ULM

Postanschrift:
Universität Bayreuth
95440 Bayreuth

Gebäude: NW II
Universitätsstraße 30
95447 Bayreuth

Telefon: 0921 55-3198

eMail: Dekanat.MPI@uni-bayreuth.de

27.10.22

EINLADUNG ZUM HABILITATIONSVORTRAG VON HERRN DR. MICHAEL BAUMANN

Herr Dr. Michael Baumann beabsichtigt, sich an unserer Fakultät im Fachgebiet Mathematik zu habilitieren und möchte daher sein Arbeitsgebiet vorstellen.

Titel: Mathematische Ansätze zu Marktmodellierung und Handel

Zeit: Donnerstag, 10. November 2022, 16:30 Uhr s.t.

Ort: Gebäude NW II, H 19

Es gibt eine Vielzahl mathematischer Modellierungen von Finanz- und Gütermärkten. In diesem Vortrag stelle ich ein weitverbreitetes heterogenes Agentenmodell vor, zeige, wo und weshalb dieses ungewollte Eigenschaft besitzt und wie diese behoben werden können. Anschließend zeige ich eine Anwendungsmöglichkeit des neuen Modells auf, nämlich die Stabilitätsanalyse von Finanzmärkten, für die börsennotierte Indexfonds verfügbar sind. Des Weiteren gebe ich Einblicke in neue Erkenntnisse bzgl. regelungsbasierter Handelsstrategien auf Ein- und Zweiaktienmärkten. Dabei wird auch die Verwendung der statistischen Schiefe als Risikoproxy kritisch diskutiert.

gez.
(Prof. Dr. Volker Ulm)