

Gewinner des Förderpreises 2024 des „Verein Versicherungswirtschaft e.V., Karlsruhe“



Constantin Merbecks

Der Förderpreis 2024 des „Verein Versicherungswirtschaft e.V.“ wurde am 26. Juni 2024 im Rahmen des Symposiums „KI in der Geschäftswelt: Erfolgsgeschichten, Chancen und Herausforderungen“, veranstaltet von der Forschungsgesellschaft „Geld – Banken – Bausparkassen – Versicherungen“ am Karlsruher Institut für Technologie (FOG am KIT) übergeben an Herrn Constantin Merbecks für seine Master Thesis: „Evaluation of Continuous Volatility Surface Estimators and Implications“ (KIT / Prof. Dr. Maxim Ulrich / Lehrstuhl „Financial Economics and Risk Management“). Die Jury schrieb „Die Arbeit ... ist als besonders hervorragend zu bewerten - sie zeige ein besonders tiefes Verständnis der zu beobachtenden Zusammenhänge und eine hervorragende Qualität und Souveränität im Umgang mit großen Datenmengen unter Einsatz moderner KI-Software (Python).“

Zusammenfassung:

Merbecks untersucht verschiedene Methoden zur Schätzung von Volatilitätsoberflächen und deren Auswirkungen auf die Schätzung von Risikoparametern, basierend auf einer halben Milliarde Optionspreisen. Die Arbeit hat als Ziel, die beste Methode für präzise Vorhersagen impliziter Volatilitäten zu identifizieren. Diese Erkenntnisse können von Versicherungsunternehmen genutzt werden, um bessere Modelle für die Bewertung von Optionen zu entwickeln und das Risiko der zugrundeliegenden Aktien genauer zu modellieren.