



*Timo Storz*

Im Rahmen seiner Thesis untersucht Timo Storz statistische Verfahren zur Schätzung von impliziten Volatilitäten in Aktienoptionen. Sein Ziel ist es, zu jedem Zeitpunkt innerhalb eines Tages eine möglichst genaue Aussage der gesamten Volatilitätsfläche zu treffen, auch wenn gerade nicht jede Kombination aus Maturity und Moneyness der Option gehandelt wird.

Diese Informationen sind besonders wertvoll im Risk Management und beim hochfrequenten Handel, insbesondere bei illiquiden Derivaten. Gemeinsam mit Prof. Ulrich und dessen Lehrstuhl wurde ein Verfahren der bayesschen Statistik entwickelt, das nun Anwendung in der Praxis und Lehre findet und stetig optimiert wird.