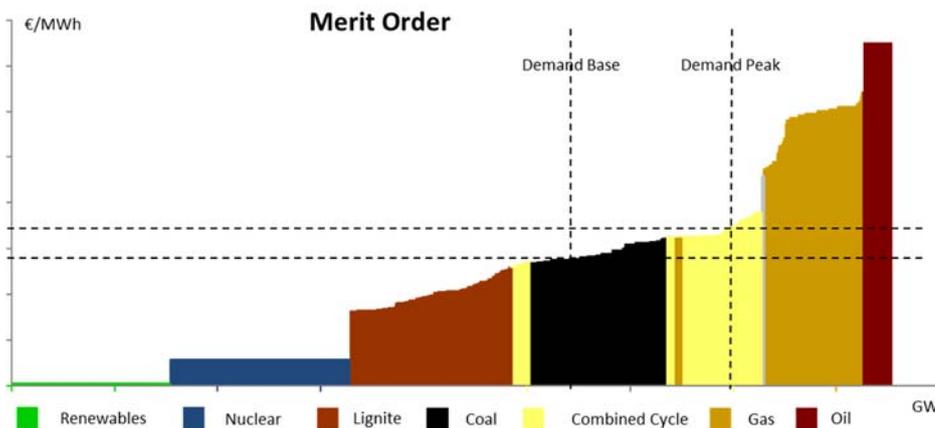


# Treffpunkt AMMO

## Finanzmathematische Modellierung in Strom- und Energiemärkten

Seit der Liberalisierung der Elektrizitätsmärkte in den 90'er Jahren wird Strom an Börsen wie der deutschen EEX gehandelt. Dadurch ergeben sich für die verschiedenen Marktteilnehmer zahlreiche Probleme und Herausforderungen, aber auch Chancen, die eine mathematische Modellierung erforderlich machen. Hierbei kommen klassische Methoden aus der Finanzmathematik zum Einsatz, aufgrund der speziellen Eigenschaften von elektrischem Strom und der besonderen Markt- und Produkt-



strukturen müssen allerdings auch neue Ansätze und Bewertungsmethoden entwickelt werden. In diesem Vortrag wird über die Aufgaben eines Mathematikers bei einem deutschen Kraftwerksbetreiber berichtet. Zudem wird ein Über-

blick über die verwendeten mathematischen Methoden gegeben.

**Donnerstag**

**03. Dezember 2015**

**14 Uhr**

**Interaktion 1**

**33619 Bielefeld**

**Raum D 014**

**Referent:** Dr. Richard Biegler-König (Steag GmbH)

**Moderator:** Prof. Dr. Claudia Cottin (FSP AMMO, FH Bielefeld)

**Alle Interessierten sind herzlich eingeladen!**