

Finanzmathematik zeigt Größe



Das HVB-Stiftungsinstitut für Finanzmathematik wurde im Oktober 2003 an der Fakultät für Mathematik der TUM in Garching eröffnet. Unterstützt wird diese Forschungseinrichtung von der HypoVereinsbank, die über einen Zeitraum von zehn Jahren rund fünf Millionen Euro zur Verfügung stellt. Leiter des Stiftungsinstituts ist Prof. Rudi Zagst.

Jährlich sollen hier rund 70 Studierende ausgebildet werden, wobei besonderer Wert auf die enge Verknüpfung von Theorie und Praxis gelegt wird. So wird derzeit ein spezieller Computer-raum als »Risk Factory und virtueller Handelsraum« eingerichtet. Hier können die Studierenden mit verschiedenen Softwareprogrammen die Praxis von Finanzmärkten und Finanzrisiken besser kennen lernen. Mit Hilfe einer in Mitteleuropa erstmals eingesetzten Software sind Bewertung und Risikomanagement auch sehr komplexer Finanzprodukte und Wertpapierportfolios möglich. Zudem besteht eine Zugriffsmöglichkeit auf aktuelle Börsenkurse und his-

torische Datenbanken, die Informationen über 30 Aktien- und Futuresbörsen enthalten. Demnächst sollen die Studierenden auch diverse Handels- und Risikosimulationen in Echtzeit durchspielen können. Durch interaktives Handeln in verschiedenen Marktszenarien wird dann das theoretische Wissen auf reale Situationen übertragen und damit die Lücke zwischen Theorie und Praxis geschlossen.

Prof. Rudi Zagst

Zum 27. Mai 2003 wurde Prof. Rudi Zagst, Professor für Finanzmathematik am Zentrum Mathematik der TU München, zum Leiter des HVB-Stiftungsinstituts für Finanzmathematik bestellt.

Rudi Zagst studierte Wirtschaftsmathematik an der Universität Ulm. Nach seiner Dissertation im Bereich der stochastischen dynamischen Optimierung ging er zur HypoVereinsbank AG. Hier war er als Leiter der Abteilung Produktentwicklung im Institutional Investment Management tätig, bevor er als Leiter Consulting zur Allfunds International Asset Management GmbH wechselte und 1997 schließlich Geschäftsführer der RiskLab GmbH - Private Research Institute for Financial Studies wurde. Seit 1992 nahm er verschiedene Lehraufträge der Universitäten Ulm, St. Gallen, Augsburg und München wahr. Nach der Habilitation 2000 an der Universität Ulm nahm er 2001 einen Ruf an die TUM auf das Extraordinariat für Finanzmathematik an und ist dort seit 2002 Mitglied im Direktorium des Zentrums Mathematik. Zudem wurde er 2003 zum Zweitmitglied der Fakultät für Wirtschaftswissenschaften ernannt. Der Schwerpunkt seiner Forschungstätigkeit liegt in den Bereichen Financial Engineering, Risiko- und Asset-Management.



Dr. Michael Kemmer übergibt den Schlüssel zum HVB-Stiftungsinstitut an dessen Leiter, Prof. Rudi Zagst; rechts: TUM-Präsident Prof. Wolfgang A. Herrmann, links: Prof. Martin Brokate, Dekan der Fakultät für Mathematik. Foto: Obermeier

Zudem haben die Studierenden weitere Möglichkeiten, sich neben ihrer wissenschaftlichen Ausbildung in der Praxis fortzubilden. So gehört ein Praktikum in einer Bank, Versicherung oder Forschungseinrichtung zum Lehrplan. Die enge Kooperation des Instituts mit der Wirtschaft erlaubt es den Studenten, einen intensiven Kontakt zu Wirtschaftsunternehmen aufzubauen. Durch den Dialog mit potentiellen Arbeitgebern erhöhen sich nicht zuletzt auch die Chancen auf einen Arbeitsplatz im Anschluss an das Studium.

Wie Dr. Michael Kemmer, Vorstandsmitglied und Chief Risk Officer der HVB Group, erklärte, ist die Finanzierung dieses Instituts für die HVB eine zukunftsweisende Entscheidung: »Die Entwicklung von immer komplexeren Finanzprodukten gerade im Bereich des Asset Management wirft schwierige finanzmathematische Fragen auf, deren Klärung für uns als Bank von großer Bedeu-

tion ist. Dazu bietet sich eine enge Kooperation von Wissenschaft und Wirtschaft an.« Zentrales Anliegen des Instituts ist es deshalb, die anspruchsvolle theoretische Ausbildung mit den Problemen der Wirtschaftsrealität zu verbinden. TUM-Präsident Prof. Wolfgang A. Herrmann sagte zur Gründung des Instituts: »Mit der Finanz- und Wirtschaftsmathematik haben wir am Banken- und Versicherungsplatz München ein Gebiet eröffnet, das aus der Verschränkung von Wissenschaft und Praxis lebt. Der attraktive gleichnamige Studiengang zählt zu den besonders nachgefragten Studienangeboten der TUM.« Und Institutsleiter Prof. Rudi Zagst ist sicher: »Mit ihrer Stiftung leistet die HVB einen wesentlichen Beitrag zur Förderung der innovativen finanzmathematischen Ausbildung an der TU München.«

V
g
i
t

I
s
t
z

F
C
C
V
C
V