

▼ MEAG Gastvortrag an der TU München

Im Rahmen der Universitätskooperation mit dem Lehrstuhl für Finanzmathematik der TU München hielt Dr. Alexander Bauer aus dem Team Marktrisikomodell am 19. Juli einen Gastvortrag zum Thema „Market Risk Attribution: Decomposing Value-at-risk“ in der Portfolio-Analysis-Vorlesung.

Nach einleitenden Worten von Prof. Dr. Rudi Zagst, Lehrstuhl für Finanzmathematik TU München, stellte Dr. Bauer rund 50 Studenten zunächst die MEAG vor, um dann auf Fragen der Marktrisikomessung einzugehen, wobei er eine Brücke zwischen den theoretischen Vorlesungsinhalten und der praktischen Umsetzung in einem Versicherungskonzern schlug.

Im Anschluss präsentierte er Inhalte aus der Masterarbeit „VaR Sensitivities and Decomposition“ von Elisabeth Ailer, die er mitbetreut hatte. Neben den fachlichen Inhalten zeigte Bauer, wie die Zusammenarbeit bei einer Masterarbeit mit Praxisbezug in der MEAG aussehen kann. Er informierte in diesem Zusammenhang

über die unterschiedlichen Einstiegsmöglichkeiten für Studierende und Absolventen bei der MEAG und skizzierte Chancen bei der MEAG anhand aktuell offener Stellen. Beim anschließenden Get-together stellte er sich gemeinsam mit der Praktikantin Lucie Stoppok und dem Werkstudent Nico Bednorz aus dem Team Marktrisikomodell den Fragen der Studenten.

Der Gastvortrag unterstrich den hohen Mehrwert der Universitätskooperation sowohl für die MEAG als auch für die beteiligten Lehrstühle und Studierenden der TU München.



Dr. Alexander Bauer erläutert den Studenten Fragen zur Marktrisikomessung.