



Bergische Universität Wuppertal Fachbereich
Mathematik und Naturwissenschaften
Angewandte Mathematik – Stochastik

iw.KÖLN.WISSEN
SCHAFFT KOMPETENZ.



Rhein-Wupper-Seminar on Financial Engineering and Risk Management

1. RWS FERM

18. Mai 2011
Bergische Universität Wuppertal, Wuppertal,
Raum T 09.01

Einladung Rhein-Wupper-Seminar on Financial Engineering and Risk Management

Das Institut der deutschen Wirtschaft Köln und die Arbeitsgruppe Stochastik der Bergischen Universität Wuppertal laden Sie zum ersten Rhein-Wupper-Seminar on Financial Engineering and Risk Management (RWS FERM) am 18. Mai 2011 in Wuppertal ein.

Der ersten Session geben wir das **Oberthema Systemisches Risiko** und berichten über Forschungsergebnisse unserer Kooperationsgemeinschaft. Anschließend wollen wir in einem Kreis von rund 30 Teilnehmern intensiv diskutieren.

In der zweiten Session tragen Wissenschaftler und Praktiker ihre Forschungsergebnisse – natürlich wieder mit der Möglichkeit zur Diskussion – vor.

Das Rhein-Wupper-Seminar on Financial Engineering and Risk Management ist eine öffentliche Veranstaltung der

Kooperation zwischen der Bergischen Universität Wuppertal – Angewandte Mathematik, dem Institut der deutschen Wirtschaft Köln und der price-it GmbH Halle.

Universitätsprofessorin Dr. Barbara Rüdiger-Mastandrea
Leiterin der Arbeitsgruppe Stochastik
PD Dr. habil. Manfred Jäger-Ambrożewicz, Leiter der Forschungsgruppe Markt und Staat und Senior Economist, IW Köln sowie Geschäftsführer der price-it GmbH.

Sie sind herzlich eingeladen, sich über die Kooperation zu informieren: Sowohl Frau Rüdiger-Mastandrea (ruediger@uni-wuppertal.de) als auch Herr Jäger-Ambrożewicz (jaeger@iwkoeln.de) geben gerne Auskunft und freuen sich über weitere Kooperationspartner.

Programm

13:30 Uhr	Begrüßung Prof. Dr. Barbara Rüdiger-Mastandrea Bergische Universität Wuppertal Dr. Manfred Jäger-Ambrożewicz Institut der deutschen Wirtschaft Köln
13:45 Uhr	Vorträge und Diskussion Systemisches Risiko Dr. Manfred Jäger-Ambrożewicz Institut der deutschen Wirtschaft Köln und Brice Hakwa Bergische Universität Wuppertal
14:45 Uhr	Kaffeepause Vorträge und Diskussion
15:15 Uhr	Bewertung von Optionen in Kreditverträgen Dr. Claas Becker Deutsche Bank
16:00 Uhr	Risk management of convertible bonds Ognyan Kounchev und Krastyu Gumnerov Universität Bonn

Systemisches Risiko

Es hat sich besonders wegen der Finanzkrise die Einsicht durchgesetzt, dass es keine gute Idee ist, die Risiken Bank für Bank einzeln zu analysieren. Gemäß einer solchen Analyse werden aber die regulativen Vorgaben an Banken berechnet. Eine systemische Analyse, die konzediert, dass Banken Schaden und Kollateralschaden anrichten, setzt sich durch und ist ein intensiv beforschtes Gebiet der Finanzmarktökonomik und der Finanzmathematik. Im Rahmen der Kooperation zwischen dem Institut der deutschen Wirtschaft Köln (insbesondere die Arbeitsgruppe Markt und Staat) und der Universität Wuppertal Arbeitsgruppe Stochastik Universitätsprofessorin Dr. Barbara Rüdiger-Mastandrea soll ein Beitrag zu diesen Forschungsanstrengungen geliefert werden. Dabei sollen Methoden der Stochastik verwandt werden, um der komplexen Thematik technisch gerecht zu werden. Die Kooperation mit der mathematischen Wirtschaftsforschung soll die Praxisnähe fördern.

Ausblick

Das RWS FERN wird drei bis vier Mal jährlich stattfinden. Wir werden uns auf einer der folgenden Veranstaltungen mit dem [Management von Energierisiken](#) beschäftigen.

Bitte informieren Sie sich auf der Internetseite www.iwkoeln.de/rwsferm oder auf www2.math.uni-wuppertal.de/~ruediger/pages/Projekte.html über unsere Veranstaltungen.

Veranstaltungsort

Bergische Universität Wuppertal

Raum T 09.01

Gauß Str. 20 Wuppertal

Telefon: 0202 439 3678

<http://www2.math.uni-wuppertal.de/~ruediger/>

<http://www.uni-wuppertal.de/index.html>

Tagungsbüro

18. Mai 2011

ab 13:00 Uhr

Telefon: 0176 32023491

Anmeldung

bis 10. Mai 2011

E-Mail: mj@finomica.de, ruediger@math.uni-wuppertal.de, hakwa@uni-wuppertal.de

Begrenzte Teilnehmerzahl

first come, first served.

Die Teilnahme ist kostenfrei.

