



Bergische Universität Wuppertal
Fachbereich Mathematik und
Naturwissenschaften
Angewandte Mathematik - Stochastik



Vortragsankündigung

Stochastische Analyse und systemisches Risiko

Kurzbeschreibung:

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 Bank-für-Bank-Analyse werden aber die regulativen Vorgaben an Banken berechnet. Eine systemische Analyse, die konzediert, dass Banken Schäden und Kollateralschäden anrichten, setzt sich immer mehr 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, soll zu diesen Forschungsanstrengungen ein Beitrag geliefert werden. Dabei sollen Methoden der stochastischen Analysis verwandt werden, um der komplexen Thematik technisch gerecht zu werden. Zu diesem Thema wird als Leiter dieses Projektes

PD Dr. Manfred Jäger-Ambrożewicz

Institut der Deutschen Wirtschaft Köln und price-[it] gmbH

am **15.11.2010** um **15.00 ct** im **Raum T09.01** der
Bergischen Universität Wuppertal

einen Vortrag mit dem Titel

Systemic Risk in a Gaussian setting and beyond ...

halten.

Danach stärken wir uns mit Kaffee und Kuchen

Brice Hakwa und Prof. Dr. Barbara Rüdiger

Arbeitsgruppe Stochastik, Bergische Universität Wuppertal

hakwa@uni-wuppertal.de, ruediger@math.uni-wuppertal.de