

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 Computerraum 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-

«...ung 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.«

MeCuM-Auftakt im Audimax



Mit einer Auftaktveranstaltung im Audimax der TUM starteten am 20. Oktober 2003 mehr als 700 Erstsemester ins »Medizinische Curriculum München« (MeCuM). Dieses neue Zukunftskonzept für die gemeinsame medizinische Ausbildung an den beiden großen Münchner Universitäten umfasst die ersten vier Semester (s. TUM-Mitteilungen 1-03/04, S. 6). Die Studierenden sind in dieser Zeit sowohl an der Ludwig-Maximilians-Universität München (LMU) als auch an der TU München eingeschrieben. Anschließend müssen sie sich für eine Hochschule entscheiden - wenn sie mehr die praktische Orientierung suchen, bleiben sie an der TUM, wenn ihnen eher die Theorie liegt, wählen sie die LMU.

Foto: Oliver Bodmer

Hochtief gibt Finanzspritze für Bau-Lehrstuhl

Ihr 100-jähriges Bestehen feierte die Baufirma Hochtief am 6. November 2003. Das Unternehmen ist durch verschiedene Bauvorhaben mit der TUM verbunden, etwa dem Neubau der Fakultäten für Mathematik und für Informatik in Garching, weshalb die Hochschule zum Geburtstagsfest in der Allerheiligen-Hofkirche eingeladen war - und sogar beschenkt wurde: Hochtief-Vorstandsvorsitzender



Was man schwarz auf weiß besitzt... Getrost in die Arcisstraße 21 tragen konnte TUM-Präsident Wolfgang A. Herrmann (M.) einen Scheck über 200 000 Euro, überreicht von (v.l.): Hochtief-Bereichsleiter Ulrich Saalfrank und den Vorstandsmitgliedern Martin Rohr, Burkhard Lohr und Friedel Abel.

Foto: Klaus Haag

Dr. Friedel Abel sagte der TUM auf der Feier offiziell eine Starthilfe von 200 000 Euro für einen neuen Lehrstuhl für Bauprozessmanagement zu. Dieser Lehrstuhl kann schon zum nächsten Sommersemester besetzt werden, sagte TUM-Präsident Prof. Wolfgang A. Herrmann. Die Fähigkeit, prozesshaft zu denken, sei besonders wichtig, um im Bauprozess von der Planung bis hin zur Bewirtschaftung eines Gebäudes Kosten einzusparen und trotz niedriger Margen Gewinne zu erwirtschaften. Deshalb hofft der TUM-Chef auf weitere Unterstützung: »Ich wäre nicht unglücklich, wenn Hochtief im Fall einer guten Lehrstuhlbesetzung an die Starthilfe eine Null dransetzt, und zwar hinten und nicht vorn«.