



Treffpunkt AMMO

Risiken im Otc-Handel

Aufgabenspektrum für Mathematiker/innen im Risikomanagementumfeld

Auf dem Over-the-Counter (Otc) Markt gehen Marktteilnehmer untereinander selbstständig Handelsverpflichtungen ein. Anhand eines Beispiels werden die daraus resultierenden Risiken und Auswirkungen auf die Risikolandschaft einer Bank dargestellt. Auch werden Maßnahmen wie das bilaterale Margining (Credit Support Annex) und das neuerdings eingeführte Central Counterparty Clearing beschrieben und deren Auswirkungen auf die Risikolandschaft aufgezeigt.

In Risk-Abteilungen wird die Verantwortung für das Risikomanagement wahrgenommen und dessen Umsetzung konzipiert. Dabei ergibt sich eine Bandbreite von Aufgaben für Mathematiker und Mathematikerinnen, welche im Vortrag entlang der verschiedenen Risiken vorgestellt werden. Als Hintergrundinformation dienen die Erfahrungen des Vortragenden aus eigenen Aufgabenfeldern sowie aus Kontakten zu anderen Mathematiker/innen innerhalb der Bank.



Donnerstag

10. Oktober 2013

14:00 Uhr

Am Stadtholz 24

33609 Bielefeld

Raum A28

Referent: Dipl. - Math. (FH) Aziz Akbaba (Zürcher Kantonalbank, Zürich)

Moderator: Prof. Dr. rer. nat. Claudia Cottin (FSP AMMO, FH Bielefeld)

Alle Interessierten sind herzlich eingeladen!