

### Abendvortrag

PV VI Mi 20:00 HZ 1+2

#### Naturwissenschaftliche Methoden zur Steuerung von Banken

— •WILFRIED PAUS — Managing Director Deutsche Bank

In den vergangenen Jahrzehnten hat die Komplexität der Steuerung von Bankgeschäft stark zugenommen. Waren dafür zunächst anspruchsvollere Produkte wie Finanzderivate oder Verbriefungen verantwortlich, haben zuletzt gestiegene regulatorische Anforderungen die strategische Entscheidungsfindung in Banken maßgeblich verkompliziert. Daher kommen in Banken immer mehr naturwissenschaftliche

Methoden zum Einsatz, um Risiko zu messen, Produkte adäquat zu bewerten und Portfolien zu optimieren. Insbesondere Mathematiker, Physiker aber auch andere Naturwissenschaftler wenden Ihre Modellierungserfahrungen verstärkt in der Finanzwirtschaft an.

Der Vortrag zeigt zunächst Parallelen zwischen naturwissenschaftlicher und bankwirtschaftlicher Modellierung auf, um dann einen Überblick über die verschiedenen Anwendungsgebiete zu geben. Anschließend werden die Gebiete anhand von realen Beispielen wie zum Beispiel Kreditbonitätsanalysen, Bilanzoptimierung unter Basel III und Portfoliosteuerung mittels ökonomischem Kapital vertieft.