

Einladung zum Würzburger Mathematischen Kolloquium

Julius-Maximilians-Universität Würzburg • Fakultät für Mathematik und Informatik

Martin Thiesen

Director Asset Management, Deutsche Bank, Frankfurt

Mathematical Tools for Asset Management

Mittwoch, 21. Juni 2017 • 16:15 Uhr

Raum SE 40, Mathematik Ost, Emil-Fischer-Str. 40, Campus Hubland-Nord

Inhaltsangabe:

In this lecture a case study will be given on how we advise a corporate client in pension risk management. We shall describe the steps we go through: risk budget discussion, mathematical modelling of liabilities and asset classes, long term parameter estimates, asset liability study, discount rate methodology and the development of supporting tools typically consisting of numerical implementations of the model.

This will illustrate to students how their knowledge is put to use at the Deutsche Bank.



www.mathematik.uni-wuerzburg.de/kolloquium.html

Zu diesem Vortrag laden wir Sie herzlich ein.

Im Anschluss an den Vortrag stehen Kaffee und Tee im Foyer vor dem SE 40 bereit.



Die Dozentinnen und Dozenten der Mathematik