

Pressemitteilung

Köln, 12. Mai 2014

GAUSS-Preis an Professor Oskar Goecke verliehen

Professor Dr. Oskar Goecke von der Fachhochschule Köln ist am 30. April 2014 in Bonn mit dem renommierten GAUSS-Preis geehrt worden. Mit der Auszeichnung (Dotierung 10.000 Euro) würdigen die Deutsche Gesellschaft für Versicherungs- und Finanzmathematik (DGVFM) sowie die Deutsche Aktuarvereinigung e.V. (DAV) den Versicherungsmathematiker für seine Arbeit „Pension Saving Schemes with Return Smoothing Mechanism“.

Darin diskutierte der stellvertretende Direktor des Instituts für Versicherungswesen ein Modell für kollektive Sparprozesse, die den Sparern einen hohen Anteil an rentablen – und somit notwendigerweise risikobehafteten – Kapitalanlagen erlauben. Kennzeichnend für kollektive Sparprozesse ist eine gemeinschaftliche Reserve, die es ermöglicht, extreme Verluste an den Aktienmärkten auszugleichen. Diese Reserve erlaubt einen Risikoausgleich zwischen den Sparergenerationen. Goeckes Ansatz beschreibt dabei Regeln, wie die Kapitalanlagen anzulegen sind und der Risikoausgleich gesteuert werden muss. „Mit seiner Arbeit liefert Professor Goecke einen innovativen Vorschlag für die Altersvorsorge“, unterstrich DGVFM-Vorstand Professor Rüdiger Kiesel in seiner Laudatio den hohen praktischen Nutzen.

Dr. Peter Hieber (Technische Universität München) und **Dr. Florentin Rahe** (Universität Ulm) erhielten den mit jeweils 2.000 Euro dotierten Nachwuchspreis. Hieber entwickelte in seiner preisgekrönten Dissertation „First-exit times and their applications in default risk management“ neue Berechnungsmethoden für Austrittswahrscheinlichkeiten eines Intervalls (mit zwei Barrieren) oder eines Halbstrahles (mit einer Barriere). „Diese mathematischen Ergebnisse haben vielfältige Anwendungsmöglichkeiten in der Finanzwirtschaft: Von der Optionspreisberechnung für Barriere-Optionen über Vorhersagen von Ausfallwahrscheinlichkeiten bis hin zur Risikobewertung bei Private-Equity Investitionen“, betonte die Jury.

Rahe obsiegte mit seiner Promotionsarbeit „Option pricing under time-varying risk aversion with applications to risk forecasting“, in der er sich mit der Modellierung der Preisentwicklungen von Vermögenswerten an Finanzmärkten beschäftigte. „Dr. Rahes Ergebnisse haben das Potenzial, künftig zu einem Standardmodell zu werden, wenn sich die positiven Resultate auf weiteren Märkten bestätigen“, hieß es zur Begründung von den Juroren.

Ausschreibungsbeginn für GAUSS-Preis im Herbst 2014

Der GAUSS-Preis wird seit 1998 alljährlich von der DGVFM und der DAV ausgeschrieben. Er soll insbesondere jüngere Aktuare, Versicherungs- und Finanzmathematiker motivieren, sich mit ungelösten Fragen der Aktuarwissenschaft zu befassen. Die nächste Wettbewerbsrunde beginnt im September 2014. Arbeiten zum Topic of the Year 2014: „Modelle, Konzepte und Algorithmen zur dynamischen Finanzanalyse“ sind ausdrücklich erwünscht.

Weitere Informationen zum Preis und Impressionen der diesjährigen Preisverleihung finden Sie unter www.aktuar.de

Die DGVFM als Fachgesellschaft der in Deutschland in Wissenschaft und Wirtschaft auf den Gebieten der Versicherungs- und Finanzmathematik sowie des quantitativen Risikomanagements tätigen Mathematiker setzt sich neben ihren Aktivitäten im Bereich der Aus- und Weiterbildung und der Nachwuchsförderung vor allem für den Transfer aktueller Forschungsergebnisse in die aktuarielle Praxis ein.

Die Deutsche Aktuarvereinigung e.V. (DAV) ist die berufsständische Vertretung der Versicherungs- und Finanzmathematiker mit derzeit rund 4.300 Mitgliedern. Ferner stehen derzeit rund 1.800 meist jüngere Finanz- und Versicherungsmathematiker nach entsprechendem Hochschulstudium und mindestens dreijähriger Berufspraxis im geregelten Ausbildungsgang zum Aktuar.

Für Rückfragen stehen wir Ihnen gern zur Verfügung.

Ansprechpartner für die Presse:

Erik Staschöfsky
Kommunikationsreferent der Deutschen Aktuarvereinigung e.V.
Telefon: 0221 / 91 25 54 42 , Fax: 0221 / 91 25 54 942,
E-Mail: erik.staschoefsky@aktuar.de