



2003-07-16 [K. Peter]

Neuberufener TU-Professor Uwe Schmock setzt bei Versicherungs- und Finanzmathematik neue Akzente

Seit 1. Juni 2003 ist Uwe Schmock Professor für Versicherungsmathematik am Institut für Finanz- und Versicherungsmathematik der TU Wien. Er hat dafür die ETH und die Universität Zürich mit einer ausgezeichneten Infrastruktur verlassen. Was den Ausschlag für seinen Gang nach Wien gab? Natürlich Wien als Stadt und der ausgezeichnete Ruf des Instituts für Finanz- und Versicherungsmathematik, für den Prof. Schachermayer europa- und weltweit bisher gesorgt hat. Prof. Uwe Schmock hat dafür Angebote aus Gießen und Hamburg ausgeschlagen, weil für ihn das der TU Wien am attraktivsten war.



Uwe Schmock freut sich über die herzliche Aufnahme an der TU Wien.

Uwe Schmock streut TU Wien Rosen

Prof. Schachermayer, 1998 Wittgensteinpreisträger (Anmerkung: der Wittgensteinpreis ist Österreichs höchst dotierter Wissenschaftspreis) hat bei seiner Entscheidung, an die TU Wien zu gehen, eine große Rolle gespielt. Uwe Schmock hebt Schachermayers Forschungsleistungen und die damit eng verknüpften Auslandsaufenthalte hervor, bei denen ForscherInnen lt. Schmock als Multiplikatoren wirken und damit "äußerst wichtig für die Reputation der eigenen akademischen Institution" sind.

"Daher war für mich die Wiener Finanz- und Versicherungsmathematik auf der Weltkarte vertreten." Prof. Schmock hat sich dadurch den Gusto geholt, seine Forscherzukunft an der TU Wien zu verbringen. Überhaupt freut sich Uwe Schmock

über die herzliche Aufnahme an der TU Wien. Dies gelte nicht ausschließlich für die unmittelbaren Kollegen, sondern auch für Frau Trenovatz, die alle Fäden im Institut in der Hand hält und mit Rat und Tat zur Seite steht, und den AssistentInnen des Instituts. Positiv überrascht ist Prof. Schmock ganz allgemein von der Internetpräsentation der TU Wien, die seiner Ansicht nach sehr weit gediehen ist. Am entsprechenden Aufbau in Zürich war er seit Anbeginn eine treibende Kraft; als aktive Form der Öffentlichkeitsarbeit kann sie seiner Meinung nach in ihrer Bedeutung gar nicht hoch genug eingeschätzt werden.

Abwechslungsreicher Lebenslauf

Uwe Schmock, gebürtiger Berliner, 42 Jahre alt, studierte Mathematik und Physik an der Technischen Universität Berlin und dem California Institute of Technology. Er promovierte 1990 an der TU Berlin bei Prof. Bolthausen mit einem Thema aus der Wahrscheinlichkeitstheorie - "On the maximum entropy principle for Markov chains and processes". Anschließend war er fünf Jahre als Postdoktorand an der Universität Zürich bei Prof. Bolthausen tätig und vier Jahre Credit Suisse Research Fellow an der ETH Zürich bei Prof. Delbaen. Wichtig für die Forscher-Karriere von Prof. Schmock war auch das 1994 gegründete RiskLab an der ETH Zürich, ein Kristallisationspunkt angewandter Forschung im Bereich Risikomanagement an der Schnittstelle zwischen Hochschule und Finanzindustrie. Uwe Schmock hat das RiskLab 1999 reorganisiert und war über zwei Jahre dessen Forschungsdirektor. Unter seinen zahlreichen Publikationen fanden bereits mehrere internationale Anerkennung. So gewann eine seiner Veröffentlichungen im Bereich der Versicherungsmathematik den Charles A. Hachemeister Prize 2000 und im Jahr 2001 den David Garrick Halmstad Memorial Prize. Beide Preise werden von amerikanischen Aktuarvereinigungen für besonders herausragende Arbeiten verliehen.

Wahrscheinlichkeitstheorie, Finanz- und Versicherungsmathematik

... sind - wenig überraschend - die Forschungsschwerpunkte von Prof. Schmock. Im Detail erforscht er

zur Zeit Abhängigkeitsstrukturen bei der Modellierung von Kreditrisiken sowie die Theorie von Wahrscheinlichkeiten großer und moderater Abweichungen gewisser Statistiken. In der Praxis hat man sich ersteres so vorzustellen. "Banken kalkulieren den Ausfall eines Kredites ein. Das stellt auch kein Problem dar. Problematisch wird es allerdings, wenn ungesicherte Firmenkredite zum Beispiel rezessionsbedingt nicht zurückbezahlt werden können. Die Abhängigkeiten, die dadurch zwischen den Firmen entstehen und zu gleichzeitigen Kreditausfällen führen, gilt es zu quantifizieren. Das ist einer meiner derzeitigen Forschungsschwerpunkte", so Prof. Schmock im Interview. Mit Studierenden des von ihm aufgebauten Ausbildungsprogramms "Master of Advanced Studies in Finance", das die ETH Zürich und die Universität Zürich gemeinsam anbieten, wird er verschiedene Szenarien zur Modellierung der Kreditrisiken beleuchten. Als "Hilfsmittel" werden dabei unter anderem neuronale Netze verwendet. Ein Projekt, das gemeinsam mit Ernst & Young in Zürich durchgeführt wird.

Universitäten versus Industrie

Ein besonderes Anliegen ist Prof. Schmock der wissenschaftliche Nachwuchs. Seiner Ansicht nach gehören Doktoranden an den Universitäten finanziell gefördert, indem sie für Tätigkeiten im Rahmen ihres Doktorates an der Uni entlohnt werden. "Nur so ist es möglich, sehr gute junge WissenschaftlerInnen an der Uni zu halten." Die große Gefahr, dass Lücken beim wissenschaftlichen Nachwuchs entstehen, sieht Uwe Schmock in der Konkurrenzsituation zwischen Universität und Industrie. "Dank der besseren Bezahlung wandern viele gute junge WissenschaftlerInnen direkt in die Industrie ab und gehen so den Universitäten verloren."

Zukunftsvisionen

Prof. Schmock hat viel für die nächsten Jahre an der TU Wien vor. Er möchte die Ausbildung verstärken, insbesondere in der Versicherungsmathematik, die Zusammenarbeit mit der Aktuarvereinigung Österreichs forcieren, ein Weiterbildungsprogramm für Berufstätige anbieten, beim bereits bestehenden Ph.D.-Programm in Finance mitwirken, das Bakkalaureat-Studium Versicherungsmathematik wie er selbst sagt "mit Leben füllen" und mit der Industrie gemeinsame Forschungsvorhaben realisieren. Die gewünschte Multiplikatorrolle erfüllt Uwe Schmock bereits jetzt für die TU Wien. Einwöchige Workshops in Südafrika (Juli 2003) und Griechenland (September 2003) sind fixer Bestandteil in seinem Terminkalender.

Uwe Schmock privat

Seine knapp bemessene Freizeit verbringt er am liebsten mit seiner Frau Ursula, die als Oberärztin beruflich ebenfalls stark engagiert ist. Das Paar ist frisch verheiratet und lebt zur Zeit noch zwischen Zürich und Wien, ein Zustand, der sich aber im Herbst 2003 zu Gunsten Wiens ändern soll, wenn eine gemeinsame Wohnung im 4. Bezirk bezogen wird. Gemeinsames Hobby ist die italienische Lebensart und wenn möglich, wird ein langes Wochenende in "bella Italia" verbracht.

Technische Universität Wien
Karlsplatz 13, 1040 Wien, Österreich
Tel. +43-1-58801-0
Fax +43-1-58801-41088

Mail an den Webmaster: webmaster@tuwien.ac.at