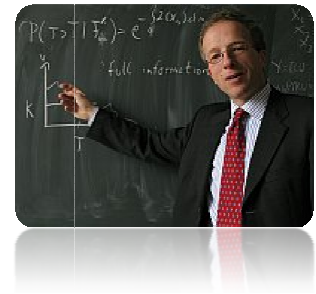


Lebenslauf

Kontaktdaten:

Name: Prof. Dr. Rüdiger Frey
 mail: ruediger.frey@math.uni-leipzig.de
 homepage: www.math.uni-leipzig.de/ ~ frey



Beruflicher Werdegang

- seit Dezember 2001 Professor (C4) für Optimierung und Finanzmathematik, Universität Leipzig
- 1999 - 2001 Assistenzprofessor für Quantitative Finance, Universität Zürich
- 1996 - 1999 UBS-Research-Fellow für Finanzmathematik (Postdoc), Department Mathematik, ETH Zürich
- 1994 - 1996 wissenschaftlicher Assistent an der Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Universität Bonn

Ausbildung

- 2001 Habilitation in Finance, Universität Zürich
- 1992 - 1996 Promotion in Financial Economics, Universität Bonn
- 1993 - 1994 Forschungsaufenthalt in Paris (DELTA, ENSAE, Paris VI)
- 1992 Diplom in Mathematik, Universität Bonn.

Forschungsinteressen:

- Finanzmathematik und Quantitatives Risikomanagement
- Stochastische Prozesse
- Financial Economics

Zusammenarbeit mit der Finanzindustrie

- seit 2010 Mitarbeit in der Arbeitsgruppe „Enterprise Risk Management“ der Deutschen Aktuarvereinigung
- 2006 - 2009 Mitglied des wissenschaftlichen Beirats von FitchRatings
- 2004 - 2007 Leiter eines BMBF-geförderten Forschungsprojekt zur Hochdimensionalen Modelle für das Kreditrisikomanagement, gemeinsam mit Risk Analytics and Instruments, Deutsche Bank, Frankfurt.
- seit 1999 Leiter verschiedener Trainingskurse und Sommerschulen zum Thema „Quantitatives Risikomanagement“

- 1998 - 1999 Consulting-Projekte im Risikomanagement für Schweizer Versicherungen und Banken

Preise

- 1996 Preis für die beste Dissertation an der Fakultät für Recht und Wirtschaftswissenschaften, Universität Bonn (Preis des Präsidenten der italienischen Republik).

Herausgebertätigkeiten:

- Mitherausgeber von "Mathematical Finance" (seit 2009)
- Section Editor, Encyclopedia for Quantitative Finance, Wiley 2009

betreute Doktorarbeiten:

- Dr. Ulrike Polte (2007) On hedging and pricing of derivatives in illiquid markets A PDE approach
- Monika Popp (2008): Simulation Techniques for Credit and Operational Risk Management
- Jochen Backhaus(2008): Pricing and Hedging of Credit Derivatives in Models with Interacting Default Intensities: A Markovian Approach
- Roland Seydel (2010): Impulse Control for Jump Diffusion: Viscosity solutions and applications in risk management

Drittmittel

- seit 2008 Projektleiter im DFG-Projekt "Credit Risk under Incomplete Information and Nonlinear Filtering"
- 2004-2007 Leiter eines BMBF-geförderten Forschungsprojektes "Hochdimensionalen Modelle im Kreditrisiko-Management"
- seit 2002 wissenschaftliches Mitglied des Graduiertenkolleg "Analysis, Geometrie und Anwendungen in den Naturwissenschaften", Universität Leipzig
- seit 2004 wissenschaftliches Mitglied der International Max Planck Research School "Mathematik und Anwendungen in den Naturwissenschaften"