Fachbereich Mathematik und
Naturwissenschaften - Mathematik -

Zeugnis der Bachelorprüfung

Herr	Ünsal Aygül
geboren am	03. März 1984
in	Herford
hat am	29. September 2010
nach der	PO Bachelor Wirtschaftsmathematik v. 2009

die Prüfung im 6-semestrigen
Bachelor-Studiengang Wirtschaftsmathematik abgelegt.

Gesamtnote: **- befriedigend -**

Wuppertal, den 14. Dezember 2010

Der Vorsitzende
des Prüfungsausschusses
Mathematik

Der Dekan
des Fachbereichs
Mathematik und Naturwissenschaften

Es wurden folgende Bewertungen erteilt:

Module	**Leistungs-punkte**	**Note**
Bereich Mathematik		
Grundlagen aus der Analysis I	9	4,0
Grundlagen aus der Analysis II	9	3,7
Grundlagen aus der Linearen Algebra I	9	4,0
Grundlagen aus der Linearen Algebra II	9	4,0
Einführung in die Numerik	9	2,7
Einführung in die Stochastik	9	3,3
Bereich Informatik		
Grundlagen der Informatik und Programmierung	9	4,0
Grundlagen der Praktischen Informatik	9	3,7
Bereich Wirtschaftsmathematik		
Finanzmathematik	9	2,3
Versicherungsmathematik	9	3,3
Einführung in das Operations Research (Diskrete Optimierung)	9	3,7
Operations Research (Lineare Optimierung)	9	2,7
Bereich Grundlagen Wirtschaftswissenschaften		
Volkswirtschaftslehre I	9	3,0
Volkswirtschaftslehre II	9	2,0
Bereich Aufbau Wirtschaftswissenschaften		
Einführung in das Rechnungswesen	9	3,0
Bereich Weiterführung Wirtschaftswissenschaften		
Finanzwissenschaft	9	3,0
Bereich Professionalisierung		
Grundlagen aus der Analysis III	9	0,0
Bachelor-Arbeit Titel: Numerische Quadraturverfahren in der Optionsbewertung	12	3,6

Gesamturteil: befriedigend (3,3)

Stadtsparkasse
Wuppertal

Bescheinigung über ein Praktikum

Herr Ünsal Aygül, geboren am 3. März 1984 in Herford, war in der Zeit vom 1. März 2010 bis 30. April 2010 als Praktikant in unserem Hause beschäftigt.

Im März setzten wir Herrn Aygül in unserer Handelsabteilung ein.
Hier erhielt er in folgende Themenbereiche einen Einblick:

- Derivative Finanzinstrumente (Zins-Swap, Zins-Cap, Devisentermingeschäft)
  - Produktdetails, theoretische Berechnung, Marktpreise
  - Rechtliche Rahmenbedingungen
  - Produktverkauf
- Geldmarkt
  - Disposition der EUR-/Fremdwährungskonten
  - Handel in Tages- und Termingeldern
  - EZB - Transaktionen
  - Mindestreserve
- Aktien- und Rentenhandel

In der Zeit vom 1. April bis 30. April 2010 unterstützte Herr Aygül die Abteilung Betriebswirtschaft im Themenbereich Liquiditätsrisikomanagement, der im Rahmen der neuen Mindestanforderungen für das Risikomanagement hohe Bedeutung bekommen hat.

Nach einer inhaltlich Einführung in den Themenkomplex "Liquidity at Risk - LaR" erarbeitete er selbständig ein stochastisches Modellkonzept, um die historisch beobachteten Nettomittelabflüsse der Sparkasse auf statistische Häufigkeit und mittels der Peaks-over-Threshold-Methode zu untersuchen. Ziel seiner Untersuchung ist es gewesen, den Auszahlungsüberschuss der Sparkasse zu bestimmen, der während eines Geschäftstages mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit nicht überschritten wird und für die Höhe der Liquiditätsreserve des Hauses eine Empfehlung abzugeben.

Herr Aygül eignete sich zunächst gewissenhaft die hierfür notwendigen theoretischen Grundlagen an, um dann ein praxisgerechtes Modell u. a. mit Hilfe von MS-Excel für die Sparkasse aufzubauen und entsprechend zu dokumentieren. Er gab uns konstruktive Hinweise hinsichtlich der modeltheoretischen Stärken und Schwächen.

Die Abteilung Betriebswirtschaft ist dankbar für seine Arbeitsergebnisse.

Wir wünschen Herrn Aygül für seinen weiteren Lebensweg alles Gute.

Wuppertal, 30. April 2010

STADTSPARKASSE WUPPERTAL