

Stefan Jaschke

Idastraße 22  
13156 Berlin

E-Mail: stefan@jaschke-net.de  
privat: (30) 2016 5252  
dienstl.: (30) 20372-453  
<http://www.jaschke-net.de>

### Ausbildung

- 08/94 bis 02/97 *Promotion, Humboldt-Universität zu Berlin*  
"Super-Hedging and Arbitrage Pricing of Bonds and Interest Rate Derivatives" , Abschlußnote: „Sehr Gut“
- 08/93 bis 05/94 *Fulbright-Stipendium, Columbia University in New York City*  
stochastische Prozesse, explorative Datenanalyse mit S-Plus, Geld und die Finanzmärkte, Finanzierung
- 05/88 bis 07/93 *Diplom in Mathematik, Humboldt-Universität zu Berlin*  
Wahrscheinlichkeitstheorie und Statistik, Komplexitätstheorie, Programmieren in C und C++; studentische Hilfskraft in Statistik; Diplomthema: "Discounting Stochastic Cash Flows and Modeling the Term Structure Dynamics"; Abschlußnote: 1.0
- 11/86 bis 04/88 *Wehrdienst*
- 09/84 bis 06/86 *Abitur, Spezialschule Mathematik/Physik der Humboldt-Universität*  
Abschlußnote: ausgezeichnet

### Arbeitsstellen

- seit 05/99 *wissenschaftlicher Mitarbeiter, Weierstraß-Institut, Berlin*  
Computational Finance, Risikomessung und -management, Zinsmodelle
- 08/94 bis 04/99 *wissenschaftlicher Mitarbeiter, Humboldt-Universität zu Berlin, Sonderforschungsbereich "Quantifikation und Simulation ökonomischer Prozesse"*  
Die zeitliche Struktur der Zinssätze: Arbitragegrenzen für die Zinsstrukturkurve, Schätzen der Zerobond-Renditekurve aus Preisen von Kuponanleihen, Steuerklienteleffekte, explorative Datenanalyse.

### Consulting und Praktika

- 09/00 to 03/01 *Consulting, Bankgesellschaft Berlin*  
Zuarbeit zu einem Gutachten von Professor Richard Stehle über ein Risikomanagementsystem.
- 09/99 to 12/99 *Consulting, Bankgesellschaft Berlin*  
Implementation einer statistischen Datenbank in C++ und POET für Value-at-Risk-Berechnungen.
- 05/99 *Consulting, CADAC GmbH, Berlin*  
Test von Zufallszahlen auf Gleichverteilung und Unabhängigkeit.
- 03/93 bis 05/93 *Praktikant/Programmierer, Deutsche Bank Research GmbH, Frankfurt*  
Implementierung statistischer Tools in C++ zur Vorhersage der Zinsstrukturkurve.
- 02/91 bis 03/91 *Praktikant, IDUNA-Nova Versicherung, Hamburg*  
Implementierung von Lebensversicherungskalkulationen in APL.
- 07/86 bis 09/86 *Anwendungsprogrammierer, Ministerium für Verkehrswesen*  
Implementierung von Teilen eines Abrechnungssystems für die Deutsche Reichsbahn in Turbo-Pascal.

Berlin, 04.03.2001