

Asset Liability Management

Wahlpflichtmodul

| | |
|--|---|
| Lehrende*r | Prof. Dr. Sebastian Schlütter Hochschule Mainz |
| Modulverantwortliche*r | Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg |
| Inhalte | Kapitalmarktmodelle, deterministische und stochastische Modelle für die Passivseite, Risikomaße, Risikoklassen, Sicherheitskapital, Testszenarien, Projektionsrechnung, Stresstests, wertorientierte Unternehmenssteuerung |
| Lernergebnisse | <ul style="list-style-type: none"> — Die Studierenden lernen die Prinzipien eines gleichzeitigen Monitorings von versicherungstechnischen und finanzmathematischen Risiken kennen. — Sie können die Risikotreiber für beide Risikoarten benennen und ihre Auswirkungen auf das Unternehmensergebnis auch für fachfremde Personen beschreiben. — Sie kennen mathematische Modelle für versicherungstechnisches und finanzmathematisches Risiko und können ihre Wirkungsweise erklären. — Sie können Kennzahlen für Finanzanlagen (zB Duration) berechnen und interpretieren. |
| Lehrformen | Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops |
| Teilnehmerzahl | max. 22 Teilnehmende |
| Voraussetzungen | Quantitative Methoden |
| Verwendbarkeit des Moduls | Wahlpflichtmodul |
| Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten | <ul style="list-style-type: none"> — regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen — Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Fallstudie und mündliche Prüfung oder Klausur |
| Kreditpunkte und Noten | Kreditpunkte: 6 KP Notenskala: 1,0 / 1,3 / 1,7 / 2,0 / 2,3 / 2,7 / 3,0 / 3,3 / 3,7 / 4,0 / 5,0 |
| Häufigkeit des Angebots | Das Modul wird in einem Turnus von ca.vier Semestern angeboten. |
| Arbeitsaufwand | Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.) |
| Dauer | ca. 20 Wochen |
| Termine | Bitte entnehmen Sie die Termine dem aktuellen Semesterkatalog |
| Gebühr | 900,00 Euro |