

Ausfallrisiko und Rating (rmf 520)

Lehrende	N.N.
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Die Veranstaltung gibt eine detaillierte Einführung in für Banken und Versicherungen wesentliche Aspekte des Managements von Ausfallrisiken, wobei der Schwerpunkt auf der Behandlung von Kreditrisiken liegt. Es werden Modellierungsverfahren für Einzel- und Portfoliokreditrisiken vorgestellt und die Konstruktion und der Einsatz von Kreditderivaten diskutiert. Darüber hinaus werden Ratingverfahren, das regulatorische Umfeld (Basel II/III, Solvency II) sowie die Rolle von Ratingagenturen in diesem Kontext ausführlich thematisiert.
Lernergebnisse	Das Modul soll die Studierenden befähigen, Ausfallrisiken von Finanzinstrumenten bzw. Kontraktpartnern quantitativ zu bewerten, die Rolle und Aussagekraft von Ratings einzuschätzen und aktuelle regulatorische Entwicklungen vor diesem Hintergrund kritisch zu beurteilen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung
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	Zur Zeit liegen keine Termine vor
Gebühren	900,00 Euro