

Quantitatives Risikomanagement

Lehrende	Dr. Daniel Clemens Dubischar
Inhalte	Empirische Bestimmung von Risikomaßen und Risikokennzahlen, wertorientiertes Risikomanagement, mathematische Grundlagen von Eigenmittelanforderungen nach Basel II/III und Solvency II, Korrelation und Diversifikation, mathematische Methoden der Risikokapitalallokation
Lernergebnisse	Die Teilnehmenden kennen die wesentlichen Risikoklassen für die verschiedenen Finanzintermediäre und können sie im Hinblick auf nationales und internationales Aufsichtsrecht einschätzen. Sie kennen statistische Risikomaße, können deren Vor- und Nachteile beschreiben und ihre Auswirkung auf die Eigenkapitalunterlegung für das Unternehmen angeben. Sie sind mit Abhängigkeitskonzepten für Finanz- und Versicherungsportfolios vertraut und können diese mathematisch beschreiben und statistisch mit Excel oder R an Daten anpassen. Gängige Konzepte für Kapitalallokation sind den Studierenden bekannt und können in einer konkreten Risikosituation ausgerechnet werden.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	20
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	Regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online Aufgaben und Kurzklausur
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 drei bis vier Semestern angeboten.
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Stunden Internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Stunden, Präsenzphasen: ca. 20 Stunden
Dauer	20 Wochen
Termine	Modulbeginn (online): 08.10.2020 Präsenzphase I: 13./14.11.2020 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Präsenzphase II: 18./19.12.2020 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Webinar zur Klausurvorbereitung (optional) 29.01.2021, 17.00 - 18.30h Klausur voraussichtlich am 19.02.2021, 13.00 - 14.00h Nachbearbeitungsphase und Modulabschluss bis (online): 07.03.2021
Gebühren	900,00 Euro