

Quantitatives Risikomanagement (rmf 150)

Lehrende	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl-von-Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl-von-Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Ruinwahrscheinlichkeiten, empirische Bestimmung von Risikomaßen und Risikokennzahlen, mathematische Grundlagen von Eigenmittelanforderungen nach Basel II/III und Solvency II, Korrelation und Diversifikation, mathematische Methoden der Risikokapitalallokation.
Lernergebnisse	Erarbeitung der Prinzipien eines Risikomanagements auf statistisch-methodischer Grundlage.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
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 Hausarbeit
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 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