

**Spezielle Themen des Risikomanagements - Extremwert und Operationelle Risiken**

<b>Lehrende</b>	Dr. Daniel Clemens Dubischar
<b>Inhalte</b>	Extremwertverteilungen und ihre Herleitung (Fréchet-, Gumbel- und Weibullverteilung), statistische Verfahren zur Schätzung des Tail-Index, Hill-Plots, Grundzüge der geophysikalischen Naturgefahrenmodelle (Event Loss Table, AEP- und OEP-Kurven), Definition und Abgrenzung operationeller Risiken, aufsichtsrechtliche Anforderungen (Basel II/III, Solvency II, MA Risk BA und VA), Grundzüge der diskreten stochastischen Finanzmathematik (Optionen und Derivate, Arbitrage und Hedging, das Cox-Ross-Rubinstein-Modell).
<b>Lernergebnisse</b>	Die Studierenden sind mit aktuellen, vertiefenden Themen des Risikomanagements vertraut, die über die Inhalte der anderen Module des Studiengangs hinausgehen. Insbesondere kennen sie Extremrisiken, wie sie bei Naturgefahren im Versicherungsbereich auftreten, operationale Risiken, die in allen Bereichen der Finanzdienstleistung von besonderer Bedeutung sind, sowie elementare Grundlagen der stochastischen Finanzmathematik. Die Studierenden können Methoden zur Bewertung von Extremrisiken sicher und selbständig anwenden. Sie kennen die Bedeutung von Optionen und Derivaten zum Hedgen von Portfolios, erkennen deren spekulative Gefahren und beherrschen ihre Handhabung.
<b>Lehrformen</b>	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
<b>Teilnehmerzahl</b>	22
<b>Voraussetzungen</b>	Keine
<b>Verwendbarkeit des Moduls</b>	Wahlpflichtmodul
<b>Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten</b>	Regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen, Webinaren und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzklausur oder Referat
<b>Kreditpunkte und Noten</b>	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
<b>Häufigkeit des Angebots</b>	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
<b>Arbeitsaufwand</b>	Gesamt: ca. 180 Stunden Internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Stunden, Präsenzphasen: ca. 20 Stunden
<b>Dauer</b>	16 Wochen
<b>Termine</b>	Sommersemester 2021, genaue Termine werden zu einem späteren Zeitpunkt bekannt gegeben.
<b>Gebühren</b>	900,00 Euro