

Spezielle Themen des Risikomanagements (rmf 210)

Lehrende	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	nach Bedarf, insbesondere: 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), Verlustdatensammlung und –aufbereitung, Risikobewertung und Reporting, Modellvalidierung.
Lernergebnisse	In diesem Modul sollen aktuelle, vertiefende Themen des Risikomanagements behandelt werden, die in dieser Form nicht in anderen Modulen des Studiengangs vorgesehen sind. Hierzu gehören z.B. Extremrisiken, wie sie bei Naturgefahren im Versicherungsbereich auftreten, oder operationale Risiken, die in allen Bereichen der Finanzdienstleistung von besonderer Bedeutung sind.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzeln 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 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