

t.RE - Risk Engineering

Kursverantwortung: Wolfgang Breymann, bwlf
Credits: 4
Schuljahr: 2009/2010
Zuletzt gespeichert: 18.08.2010 11:13

Lernziel:

Die Studierenden sind mit der Bedeutung des quantitativen Risikomanagements und den wichtigsten Verfahren zur Quantifizierung finanzieller Risiken vertraut und können sie in der Praxis anwenden.

Lerninhalt:

- Der regulatorische Rahmen
- Risikofaktoren
- Verlustverteilungen
- Risikomasse
- Standardmethoden zur Bestimmung des Marktrisikos (historische Simulation, Monte-Carlo-Simulation, Backtesting)
- Modellierung multivariater Verlustverteilungen (Mischverteilungen, elliptische Verteilungen)
- Volatilitätsmodelle
- Quantifizierung und Modellierung von Abhängigkeiten
- Grundlegende Elemente der Extremwerttheorie
- Kreditrisikomodelle
- Aspekte des operationellen Risikos

Vorkenntnisse:

Mathematik der Finanzmärkte 1

Durchführung:

Unterrichtsart	Anzahl Lektionen pro Woche
Vorlesung	14x(2L+2L)
Übung/Praktika	
Gruppenunterricht	
Blockunterricht	
Seminar	

Leistungsnachweise:

Laut Tabelle oder gemäss schriftlicher Festlegung des Dozierenden zu Semesterbeginn!

Anzahl	Art	Gewichtung
1	Modulendprüfung	3
1	Prüfungen während Unterrichtszeit	1
	Weitere Leistungsnachweise	

Unterrichtssprache:

Deutsch

Unterrichtsunterlagen:

Skript oder der Vorlesung zugrundeliegendes Lehrbuch

Wird zu Semesterbeginn bekanntgegeben

Bemerkungen:

-