

t.RE - Risk Engineering

Kursverantwortung: Wolfgang Breymann, bwlf
Credits: 4
Schuljahr: 2011/2012
Zuletzt gespeichert: 08.05.2012 15:20

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- und Statistikausbildung des WI-Studienganges

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
1	Weitere Leistungsnachweise	1

Unterrichtssprache:

Deutsch

Unterrichtsunterlagen:

Lehrbuch von A. McNeil et al., Quantitative Risk Management;
Skript bzw. Folien zur Vorlesung.

Bemerkungen:

-