

Modulbezeichnung		Kurzbezeichnung
Stochastische Modelle der Risikoanalyse		12-M-RA-102-m01
Modulverantwortung		anbietende Einrichtung
Dekan/in Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät		Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät
ECTS	Bewertungsart	zuvor bestandene Module
5	numerische Notenvergabe	--
Moduldauer	Niveau	weitere Voraussetzungen
1 Semester	weiterführend	--
Inhalte		
<p>Punkt- und Bereichsschätzung beim Value at Risk Punkt- und Bereichsschätzung beim Conditional Value at Risk Vorhersage des Value at Risk in Zeitreihen Risiko von Vorhersagen in Zeitreihen, insbesondere Exponential Smoothing under Covariates Conditional Heteroscedasticity: ARCH, GARCH, EGARCH, DVEC, BEKK, DCC Aggregierte Verluste, empirische Behandlung Nichtparametrische Schranken für Value at Risk und Conditional Value at Risk Empirische Schätzung von nichtparametrischen Schranken für Value at Risk und Conditional Value at Risk Marktmodell: Definition, Kenngrößen, empirische Behandlung Capital Asset Pricing Modell: Definition, Kenngrößen, empirische Behandlung Portfolio: Definition, Kenngrößen, Risikomessung Schätzung von Portfoliorisikoparametern: Varianz, Value at Risk, Conditional Value at Risk, Shortfall Optimale Portfolios Numerische Berechnung optimaler Portfolios</p>		
Qualifikationsziele / Kompetenzen		
<p>Der Studierende kann Risikomaße und die Parameter von Risikomodellen aus Daten zu schätzen. Insbesondere verfügt der Studierende über Softwarekenntnisse, vermittels deren eine empirische Risikoevaluation in einem Unternehmensumfeld durchgeführt werden kann.</p>		
Lehrveranstaltungen (Art, SWS, Sprache sofern nicht Deutsch)		
V + Ü (keine Angaben zu SWS und Sprache verfügbar)		
Erfolgsüberprüfung (Art, Umfang, Sprache sofern nicht Deutsch / Turnus sofern nicht semesterweise / Bonusfähigkeit sofern möglich)		
Klausur (ca. 60 Min.)		
Platzvergabe		
--		
weitere Angaben		
--		
Arbeitsaufwand		
--		
Lehrturnus		
--		
Bezug zur LPO I		
--		
Verwendung des Moduls in Studienfächern		
Master (1 Hauptfach) Business Management (2010)		