

<b>Modulbezeichnung</b>		<b>Kurzbezeichnung</b>
Stochastische Modelle der Risikoanalyse		12-RM-RA-102-m01
<b>Modulverantwortung</b>		<b>anbietende Einrichtung</b>
Dekan/in Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät		Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät
<b>ECTS</b>	<b>Bewertungsart</b>	<b>zuvor bestandene Module</b>
5	numerische Notenvergabe	--
<b>Moduldauer</b>	<b>Niveau</b>	<b>weitere Voraussetzungen</b>
1 Semester	weiterführend	--
<b>Inhalte</b>		
<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>		
<b>Qualifikationsziele / Kompetenzen</b>		
<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>		
<b>Lehrveranstaltungen</b> (Art, SWS, Sprache sofern nicht Deutsch)		
Ü + V (keine Angaben zu SWS und Sprache verfügbar)		
<b>Erfolgsüberprüfung</b> (Art, Umfang, Sprache sofern nicht Deutsch / Turnus sofern nicht semesterweise / Bonusfähigkeit sofern möglich)		
Klausur (ca. 60 Min.)		
<b>Platzvergabe</b>		
<p>Plätze: 30. Für den Fall, dass die Zahl der Bewerbungen die Zahl der verfügbaren Plätze übersteigt, erfolgt die Verteilung der Teilnahmeplätze nach folgender Maßgabe: (1) Vorrangig werden Bewerber/-innen aus dem Master-Studienfach Wirtschaftsinformatik berücksichtigt. (2) Verbleibende Plätze stehen Studierenden weiterer Studienfächer zur Verfügung. (3) Sollten bei der Vergabe nach (1) und (2) die vorhandenen Plätze für die Zahl der Bewerber/-innen nicht ausreichen, so erfolgt die Zuweisung der Plätze innerhalb dieser Gruppe nach folgenden Quoten: 1. Quote (50% der Teilnehmerplätze): Summe der bisher erreichten ECTS-Punkte aus dem jeweiligen Studienfach; im Falle des Gleichrangs wird gelöst. 2. Quote (25% der Teilnehmerplätze): Anzahl der Fachsemester des jeweiligen Bewerbers bzw. der jeweiligen Bewerberin; im Falle des Gleichrangs wird gelöst. 3. Quote (25% der Teilnehmerplätze): Losverfahren. (4) Innerhalb der Gruppen nach (1) und (2) werden jeweils zunächst Bewerber/-innen berücksichtigt, welche bereits mindestens ein Teilmodul des betreffenden Moduls bestanden haben. (5) Für sämtliche teilnahmebeschränkten Lehrveranstaltungen des Teilmoduls wird ein gemeinsames Verfahren durchgeführt. (6) Für nachträglich freiwerdende Plätze werden Nachrückverfahren durchgeführt.</p>		
<b>weitere Angaben</b>		
--		
<b>Arbeitsaufwand</b>		
--		
<b>Lehrturnus</b>		
--		
<b>Bezug zur LPO I</b>		
--		

**Verwendung des Moduls in Studienfächern**

Master (1 Hauptfach) Wirtschaftsinformatik (2011)  
Master (1 Hauptfach) Wirtschaftsinformatik (2013)  
Master (1 Hauptfach) Wirtschaftsinformatik (2014)  
Master (1 Hauptfach) Business Management (2013)  
Master (1 Hauptfach) Business Management (2014)  
Master (1 Hauptfach) Business Management (2011)