

Asset Liability Management (rmf 540)

Lehrende	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Kapitalmarktmodelle, deterministische und stochastische Modelle für die Passivseite, Risikomaße, Risikoklassen, Sicherheitskapital, Testszenarien, Projektionsrechnung, Stresstests, wertorientierte Unternehmenssteuerung
Lernergebnisse	Erarbeiten der Prinzipien eines gleichzeitigen Monitorings von versicherungstechnischen und finanzmathematischen Risiken auf Basis statistischer Modelle mit Fokus Solvency II
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
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