

Risikomodelle (rmf 510)

Lehrende	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Beschreibung und Modellierung von Risiken durch Wahrscheinlichkeitsverteilungen, das kollektive Modell der Risikotheorie, statistische Modelle für Naturgefahren und Katastrophenschäden, Grundlagen der zeitdiskreten Finanzmathematik (Aktienkursmodelle und Optionen), Risikomaße (Value at Risk, Expected Shortfall, kohärente Risikomaße), Risikoaggregation, Risikoentlastung (Rückversicherung / Finanz-Derivate), Modellierung stochastisch abhängiger Risiken.
Lernergebnisse	Erarbeitung grundlegender mathematisch-statistischer Methoden zur Modellierung und quantitativen Bewertung von Risiken.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzeln 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