

PD Dr. Hans Rau-Bredow

Vorlesung im Wintersemester 2018 an der Universität Würzburg

10 54 970 Risikomanagement III: Modellierung von Finanzmarkt- und Kreditrisiken

Blockveranstaltung am **Freitag, 7. Dezember 2018, 11:15 – ca. 17 Uhr**,

Ort: Neue Universität am Sanderring, Seminarraum 112

Gegenstand der Veranstaltung ist die Quantifizierung von Marktpreis- und Kreditausfallrisiken.

Gliederung:

1. Marktrisiko

- Aktienkursrisiken
- Zinsänderungsrisiken (Duration)
- Optionspreisrisiken (Delta-Plus-Methode, Szenario-Matrix-Analyse)
- Interne Modelle zur Berechnung des Marktrisikos

2. Kreditrisiko

- Gesamtbanksteuerung (ökonomisches Kapital, erwartete und unerwartete Verluste)
- der Kreditrisiko-Standardansatz (KSA)
- auf bankinternen Ratings basierende Ansätze (IRB-Approach)
- erweiterte Kreditrisikomodelle (Creditmetrics, CreditRisk+)

Hinweise:

- wenn Sie eine Teilnahmebestätigung erhalten möchten, schicken Sie bitte vorab eine E-Mail mit Ihrem Namen und Matrikelnummer an hans.rau-bredow@uni-wuerzburg.de (ECTS-Punkte können leider nicht erworben werden; ein Leistungsnachweis ist nicht vorgesehen.)

- ein Foliensatz wird einige Tage vor der Veranstaltung hier unter wuecampus2.uni-wuerzburg.de, auf www.rau-bredow.de und auf der Lehrstuhlhomepage bereitgestellt.

- es sind keine Vorkenntnisse erforderlich. Der Besuch kann unabhängig von den vorangegangenen Veranstaltungen Risikomanagement I und II erfolgen.