

Wahlmodul im SS09: Risikomanagement in Banken

Themen der Vorlesung

1. Risikomanagement-Prozess, bankbetriebliche Risikoarten
2. Baseler Eigenkapital-Vereinbarung (Basel II)
3. Modellierung und Fallstudien zu Eigenkapital-Anforderungen
4. Value-Based-Management, Kennzahlen-basierte Steuerung
5. Einfluss von Schätzfehlern bei der Portfolio-Optimierung
6. Stylized Facts of Empirical Finance (Heteroskedastizität, Fat Tails, Tail Dependence)
7. Exkurs zur Bayesschen Statistik
8. Robuste Optimierung, Black-Litterman-Allokation
9. ggf. Portfolio-Optimierung auf Basis anderer Risikomaße (z.B. CVaR)

Auf Wunsch wird die Vorlesung in englischer Sprache angeboten.

Voraussetzungen

- Inhalte der Bachelor-Veranstaltung „Portfoliotheorie und Risikomanagement“, insbesondere Optimierung nach Markowitz und CAPM
- Inhalte der Bachelor-Veranstaltungen Wahrscheinlichkeitstheorie, Statistik I und II

Prüfung

Klausur oder mündliche Prüfung

Anmeldung

Per e-mail bei den Dozenten bis zum 20. Februar 2009