

PD Dr. Hans Rau-Bredow

Vorlesung im Sommersemester 2018 an der Universität Würzburg

10 54 970 Risikomanagement in Banken: Wahrscheinlichkeitstheoretische Grundlagen

Blockveranstaltung am **Freitag, 18. Mai 2018, 11:15 – ca. 17 Uhr,**

Ort: Neue Universität am Sanderring, Hörsaal 414

Insbesondere seit der letzten Finanzkrise ist die Bedeutung einer korrekten mathematischen Modellierung von Risiken verstärkt in den Blick geraten. In dieser Veranstaltung wird eine elementare Einführung in die Berechnung von Finanzmarkt- und Kreditausfallrisiken gegeben:

Inhalt:

- Risiko versus Unsicherheit / Banken-Stresstests
- Erwartete und unerwartete Verluste / Ökonomisches Kapital / Risikomaße
- Gesetz der großen Zahlen / Zentraler Grenzwertsatz / Stochastische Abhängigkeit von Kreditausfallrisiken

Hinweise:

- wenn Sie eine Teilnahmebestätigung erhalten möchten, schicken Sie bitte vorab eine E-Mail mit Ihren 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 der Veranstaltung im Wintersemester 2017/18 (dort war Thema: Europäische Bankenunion, Basel I bis III) erfolgen.