

MSc-Modul

Quantitative (Kredit-)Risikomodellierung – Theorie und Praxis –

Die Professur für Rechnungslegung / ifG Marburg bieten in Kooperation mit **KPMG Frankfurt** (Team Credit Risk im Bereich „Financial Services“) im SoSe 2022 das MSc-Modul „**Quantitative (Risiko-)Modellierung – Theorie und Praxis**“ (Veranstaltungsnummer: LV-02-021-212) an:

Dozenten: Dipl.-Math.oec. Daniel Börstler [KPMG Frankfurt]
Tim Burger, M.Sc. (WiMa) [Universität Marburg]
Prof. Dr. Sascha H. Mölls [Universität Marburg]

Zeit und Ort: **Freitag, 12.00 – 16.00 Uhr** (14-tägiger Rhythmus von VL/UE) mit **Präsenz- und Digitalterminen**
Beginn: 22. April 2022
Hörsaal HG +2/0090 (Biegenstraße 14)

Ziel und Inhalt:

Die Veranstaltung „Quantitative Kreditrisikomodellierung in Theorie und Praxis“ behandelt die vielfältigen Probleme im Rahmen der Messung, Steuerung und Kontrolle von Kreditrisiken, deren enorme volks- und betriebswirtschaftliche Relevanz in der Finanz- und Eurorkrise eindrucksvoll bestätigt wurde. Zu Beginn der Veranstaltung werden zunächst grundlegende theoretische und empirische Zusammenhänge aufgezeigt und analysiert. Im Zentrum stehen im weiteren Verlauf Fragen der Bewertung von Kreditrisiken. Es werden in einem praxisnahen Kontext die Modellierungsansätze von Kreditportfolios (Erwarteter und unerwarteter Verlust) sowie weiterführende Methoden zur Modellierung und Validierung von Risikoparametern (Probability-of-Default (PD), Loss-Given-Default (LGD) und Exposure-at-Default (EAD)) behandelt. Aktuelle Entwicklungen im Kreditrisiko, wie z.B. die Umsetzung von IFRS 9, sind Teil der Veranstaltung. Der Kurs greift damit ein breites Spektrum höchst relevanter und aktueller Themen aus Theorie und Praxis des Bereichs „Accounting & Finance“ auf.

Anrechenbarkeit:

Das Modul „Quantitative (Kredit-)Risikomodellierung – Theorie und Praxis“ (VL und UE / 6 LP) kann im SoSe 2022 standardmäßig in den „**Methodenbereich**“ eingebracht oder von Wirtschaftsmathematiker/-innen als **WiWi-Modul** belegt werden. Eine Anmeldung ist weiterhin über Marvin möglich!