

Seminar im SoSe 2023

„Quantitative Methoden im Risikomanagement“

- Aktuelle Trends im Kontext „Nachhaltigkeit“ -

Im Seminar zum Thema „Quantitative Methoden im Risikomanagement“, das im Sommersemester 2023 von den Professuren für Stochastik (FB Mathematik und Informatik) und der Professur für Rechnungslegung (FB Wirtschaftswissenschaften) gemeinsam angeboten wird und darüber hinaus Gastbeiträge aus der betrieblichen Praxis zu ausgewählten Themen enthalten soll, werden Verfahren des quantitativen Risikomanagements im Kontext aktueller Fragestellungen zur Nachhaltigkeit thematisiert. Konkreter Hintergrund sind einerseits die jüngeren Entwicklungen in den aufsichtsrechtlichen Vorgaben für Banken und Versicherungen sowie andererseits Trends im Kontext der Unternehmenspublizität, die durch internationale Verlautbarungen ebenfalls zunehmend in die Nähe des finanzwirtschaftlichen (Kredit-)Risikomanagements rückt. Mit Blick auf diese Entwicklungen stehen sowohl konzeptionelle (methodische) Fragen als auch praktische Umsetzungsprobleme im Mittelpunkt des Seminars.

Teilnehmerkreis:

- Studierende im B.Sc. und M.Sc. Betriebswirtschaftslehre (mit quantitativer Schwerpunktsetzung) [Wertigkeit: 6 LP]
- Studierende im M.Sc. Quantitative Accounting and Finance [Wertigkeit: 6 LP]
- Studierende im B.Sc. und M.Sc. (Wirtschafts-)Mathematik [Wertigkeit: Einbringung als WiWi-Modul mit 6 LP oder als Mathematik-Modul mit 3 LP]

Die Leistungen im Seminar (Schriftliche Ausarbeitung, Vortrag und Mitarbeit) können in **Deutsch oder Englisch** erbracht werden!

Themenliste:

1. Lifetime Expected Credit Losses: Erweiterte Verlustantizipation nach IFRS 9 – Darstellung und Würdigung
2. Erklärbarkeit von Machine Learning in der PD Bestimmung
3. ESG-Ratingagenturen – Inhalt, Entwicklung und Reichweite
4. „Green-Regulatorik“ – Der Effekt ökologischer regulatorischer Anforderungen auf die Kreditwürdigkeit
5. Integration von Umweltrisiken in Kreditrisikoprozesse
6. Repräsentativitätsanalysen von Stichproben
7. Imputierungsverfahren für PD-Modelle

8. Importance Sampling-Methoden zur PD- und Verlustschätzung
9. Risikomaße für Systemrisiko

Organisatorische Eckdaten:

- **Anmeldung:**

Die Anmeldung ist bis zum **11. April 2023 bis 12.00 Uhr** unter Nennung Ihres Studiengangs und Ihrer Vertiefungsfächer sowie möglicher Themenpräferenzen unter **rlsek@wiwi.uni-marburg.de** möglich.

Bitte auch der **ILIAS-Gruppe** zur LV-12-105-231 am FB 12 (gemeinsame Gruppe mit der LV-02-021-179 am FB 02) beitreten (der Beitritt zur ILIAS-Gruppe ist noch keine verbindliche Anmeldung zu der Veranstaltung).

- **Themenzuteilung / Einführungsveranstaltung:**

Die **Themenzuteilung** unter Beachtung Ihres Studiengangs sowie Ihrer Vertiefungsfächer erfolgt am **17. April 2023** im Rahmen einer Einführungsveranstaltung mit dezidierten (inhaltlichen) Hinweisen und Literaturempfehlungen. Das konkrete Format der Veranstaltung wird zu gegebener Zeit bekannt gegeben.

- **Ablauf des Seminars:**

Das Seminar (Vortragsteil) findet als geblockte Präsenzveranstaltung im Juni 2023 (am 16.06. und/oder 30.06.2023) statt. Danach besteht die Möglichkeit, die schriftlichen Ausarbeitungen (Hausarbeiten) bis Mitte September 2023 zu verfassen.

Die verpflichtende Abstimmung über die **Gliederung** der Hausarbeit auf der Basis einer ausreichenden Menge einschlägiger Literaturquellen hat mit dem/der zugewiesenen Betreuer/in bis zum **1. Juni 2023** ausgehend von den Teilnehmer/-innen zu erfolgen!

gez.
Hajo Holzmann
Sascha Mölls