

Neues MSc-Modul im Bereich „Accounting & Finance“

Die Professur für Rechnungslegung / ifG Marburg bieten zusammen mit **KPMG Frankfurt** (Team Credit Risk im Bereich „Financial Services“) ab dem SoSe 2019 ein neues MSc-Modul im Schwerpunkt „Accounting & Finance“ an:

Quantitative Kreditrisikomodellierung in Theorie und Praxis

(Veranstaltungsnummer: LV-02-021-212)

Dozenten: Dipl.-Math.oec. Daniel Börstler [KPMG Frankfurt]
Philipp Hofmann, M.Sc. (WiMa) [Universität Marburg]



Zeit und Ort: Freitag, 12.00 – 16.00 Uhr (14-tägiger Rhythmus mit VL und UE) [Beginn: XXX]
Seminarraum **AA 209** (Altes Amtsgericht)

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 dann Fragen der Bewertung von Kreditrisiken. Es werden in einem praxisnahen Kontext die Modellierungsansätze von Kreditportfolien (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 (Financial Instruments), sind Teil der Veranstaltung. Der Kurs greift damit ein breites Spektrum höchst relevanter Themen aus Theorie und Praxis des Bereichs „Accounting & Finance“ auf.

Empfohlener Teilnehmerkreis:

- Studierende im M.Sc. Betriebswirtschaftslehre („Accounting & Finance“)
- Studierende im M.Sc. Quantitative Accounting and Finance
- Exportmodul für Nebenfachstudierende [insbesondere Studierende im M.Sc. Wirtschaftsmathematik sowie im M.Sc. Mathematik (ggf. fortgeschrittene B.Sc.-Studierende in den genannten Studiengängen)]