

Modul: Risk Engineering	FS 2022	14 Unterrichtswochen + 2 Prüfungswochen
--------------------------------	----------------	--

Unterrichtsmaterial/Literatur
Foliensätze C. Schmidhuber Repetitionsblätter C. Schmidhuber
Aufbauend auf: Skript und Foliensatz W. Breymann Lehrbücher: McNeils et al., Quantitative Risk Management
Übungsserien: werden während des Semesters verteilt
Probetests: 2 Zwischenklausuren, werden mit je 20% in der Endnote bewertet. Upgrade der Vornote um bis zu 0.5 durch erfolgreiches Vorrechnen im Praktikum.

Woche	Provisorischer Unterrichtsplan	Selbststudium
Woche 1 KW 8 22.2.	Einführung	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 2 KW 9 1.3.	Risikomasse	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 3 KW 10 8.3.	Faktormodelle	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 4 KW 11 15.3.	Multivariate Modelle	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 5 KW 12 22.3.	„Fat Tails“ und Skewness	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 6 KW 13 29.3.	ARCH & GARCH	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 7 KW 14 5.4.	Zwischenklausur	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.

Woche	Unterricht	Selbststudium
Woche 8 KW 15 12.4.	Copulas	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 9 KW 16 19.4.	Extremwerttheorie	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 9 KW 16 26.4.	Merton-Modell	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 11 KW 18 3.5.	Kreditrisiko	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 12 KW 19 10.5.	Basel-Regulationen	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 13 KW 20 17.5.	Ausblick	Nacharbeiten der Vorlesung. Vorbereitung des Praktikums. Lösen von Übungsaufgaben.
Woche 14 KW 21 24.5.	Zwischenklausur	Wiederholung des Semesterstoffes. Lösen von Übungsaufgaben.
KW 22 30.5. – 3.6.	Unterrichtsfreie Zeit	Vorbereitung auf die Modulschlussprüfungen
KW 23 6.6. – 10.6.	Unterrichtsfreie Zeit	Vorbereitung auf die Modulschlussprüfungen
KW 24 20.6. – 25.6.	Modulschlussprüfungen nach Prüfungsplan	Vorbereitung auf die Modulschlussprüfungen
Woche 15 KW 3 27.6. – 2.7.	Modulschlussprüfungen nach Prüfungsplan	Prüfungsplan wird durch das Studiengangsekretariat erstellt
Woche 16 KW 4 22.6. – 27.6.	Modulschlussprüfungen nach Prüfungsplan	Prüfungsplan wird durch das Studiengangsekretariat erstellt

Woche	Unterricht	Selbststudium
-------	------------	---------------

Ausweis Workload

Elemente Studium	Workload	Anzahl Arbeitsstunden
Kontaktstudium	14*4 Lektionen	56
Geleitetes Selbststudium	- Übungsaufgaben lösen - Theorie erarbeiten	28
Autonomes Selbststudium	- Lektionen vor- und nachbereiten - Prüfungsvorbereitung	36
	Total Workload in Stunden	120
	Total ECTS	4