

Ausschreibung Master-Seminar:
Excel-Anwendungen im finanziellen Risikomanagement

Ziel des Seminars ist es, fortgeschrittene Anwendungen in Microsoft Excel (oder einem analogen Tabellenkalkulationsprogramm) anhand relevanter Problemstellungen im Risikomanagement zu erarbeiten und zu implementieren. Grundlegende Excelkenntnisse werden als bekannt vorausgesetzt, es wird keine technische Einführung geben. Erläuterungen/Darstellungen zur Implementierung im Tabellenkalkulationsprogramm dürfen bis zu 50% der schriftlichen Seminararbeit ausmachen. Die Excel-Datei muss mit abgegeben werden.

Seminarthemen:

- M1. Risikoquantifizierung anhand der volatilitätsgewichteten historischen Simulation
- M2. Risikoquantifizierung anhand der exponentiell gewichteten historischen Simulation
- M3. Alternative Möglichkeiten zur Bestimmung der Volatilität
- M4. Parametrische Ansätze zur Bestimmung des VaR: Normal- und t-Verteilung
- M5. Erweiterungen des VaR
(z.B.: Incremental VaR, Gitter-Monte-Carlo-Simulation, CondVaR)
- M6. Risikoquantifizierung bei nichtlinearen Produkten
- M7. Ermittlung des Basiszinssatzes in der Unternehmensbewertung

Anrechnung

Alle Themen sind im Risikomanagement (Master CRM) anrechenbar.

Zu erbringende Leistungen/Terminplan:

- 11.03.2020, 9:00 Uhr: Einführungsveranstaltung mit (Kurz)Einleitung zum wissenschaftlichen Arbeiten
- 09.04.2020: Frist zur Gliederungsbesprechung
- 04.05.2020: Abgabe der Seminararbeit, formatiert gemäß der Formatvorlage des Lehrstuhls (s. Homepage Wiedemann), einzige Abweichung: Umfang des

Textteils inkl. aller Abbildungen und Tabellen, exkl. Verzeichnisse und Anhänge: 15 Seiten.

- 11.05.2020: Präsentationstraining. Die Teilnahme ist freiwillig. Ort und Zeit wird noch bekannt gegeben, Anmeldung bei christiane.bouten@uni-siegen.de
- Die Zulassung zu den Vorträgen erfolgt spätestens am 18.05., danach Vorbereitung der Präsentation mit den weiteren Bearbeitern des gleichen Themas.
- Die Vorträge zu den schriftlichen Arbeiten sind am 29.05. (vorlesungsfreie Zeit Pfingsten) ganztags.

Die genannten Termine sind Pflichttermine (mit Ausnahme des Präsentationstrainings)! Bitte melden Sie sich folglich nur an, wenn Sie an den oben genannten Terminen anwesend sein können. Auf Überschneidungen mit sonstigen Lehrveranstaltungen kann leider nicht eingegangen werden. Die **Anmeldung und Platzvergabe** erfolgen zentral über unisono. Bitte beachten Sie bezüglich der Fristen die Veröffentlichungen auf der Homepage vom Prüfungsamt und/oder Dekanat.