

Excel-Workshop zum anwendungsorientierten Einsatz der Monte-Carlo-Simulation im unternehmerischen Risikomanagement



Termin: 12.01.2012

Zeit: 16:00 h – 18:00 h

Raum: HC-3302

Die Veranstaltung richtet sich insbesondere an Studenten des CRM-Masters, die die Vorlesung Risikomanagement in Unternehmen aktuell besuchen oder bereits besucht haben. Interessierte Studenten anderer Studiengänge sind ebenfalls herzlich willkommen. Die Veranstaltung baut auf der Vorlesung auf und legt den Schwerpunkt auf die Vertiefung folgender Inhalte:

1. Schätzung der Parameter der Fleishman-Verteilung aus historischen Daten
2. Einsatz der Cholesky-Zerlegung zur Erzeugung korrelierter Zufallspfade
3. Bestimmung des VaR für Fremdwährungspositionen mittels Monte-Carlo-Simulation

Ziel ist es, die Konzepte zunächst kurz theoretisch einzuführen. Im Anschluss daran steht die Umsetzung der vorgestellten Konzepte mittels Excel/VBA in Kleingruppen im Vordergrund. Bitte bringen daher Sie zur Veranstaltung einen Laptop mit, auf dem Microsoft Office 2003 oder eine höhere Version installiert ist. Grundlegende Excel-Kenntnisse sind erforderlich. Arbeitsmaterialien werden noch bereitgestellt.

Da die Anzahl der Teilnehmer limitiert ist, bitte ich Sie sich bis zum 06.01.2012 bei Herrn Six (six@bank.wiwi-siegen.de) anzumelden.

Die Teilnahme ist freiwillig, die Inhalte sind nicht klausurrelevant und es werden keine Kreditpunkte vergeben.