

**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. Simulation von Kursverläufen
- M5. Bestimmung des Cash Flow at Risk für Wechselkursrisiken
- M6. Risikoquantifizierung mittels des Varianz-Kovarianz-Ansatzes unter Variation der Renditeverteilung: t-Verteilung und Normal Mixtures

**Anrechnung**

Alle Themen sind im Risikomanagement (Master CRM) anrechenbar.

**Zu erbringende Leistungen/Terminplan:**

- 02.03.2016, 10:00 Uhr: Einführungsveranstaltung, anschließend: Möglichkeit zur Besprechung der Gliederung. Alternativ können auch Termine zur Gliederungsbesprechung ausgemacht werden, spätestens muss die Besprechung jedoch bis 01.04.2016 erfolgt sein.
- 06.06.2016, 12 Uhr: Abgabe der Seminararbeit, formatiert gemäß der Formatvorlage des Lehrstuhls (s. Homepage), einzige Abweichung: 18 (statt 20) Seiten.

- Die Vorträge zu den schriftlichen Arbeiten sind am 22.06. und 29.06.16 (Mittwochs) jeweils von 12 bis 18 Uhr. Es besteht an allen Tagen Anwesenheitspflicht, unabhängig vom jeweiligen Vortragsdatum.

#### Seminaranmeldung:

- ✓ Die genannten Termine sind Pflichttermine! 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.
- ✓ Schriftliche Anmeldung für das Seminar bis Freitag, den 05.02.2016, 12 Uhr, am Lehrstuhl für Finanz- und Bankmanagement (Postfach Ebene 5, Bauteil C).
- ✓ Bitte reichen Sie die **vollständigen Bewerbungsunterlagen** ein:
  - Ausgefülltes und unterzeichnetes Anmeldeformular, Download unter <http://www.wiwi.uni-siegen.de/banken/lehrstuhlteam/lehrkraft/seminare.html?lang=de>
  - aktueller Studienkontoauszug
- ✓ **Bestätigung/Absage der Seminarplätze** seitens des Lehrstuhls bis zum 10.02.2016.
- ✓ **Annahme des zugeteilten Seminarplatzes** der Studierenden über das HIS-POS (analog einer Klausuranmeldung) bis zum 15.02.2016. Andernfalls verfällt der Seminarplatz.
- ✓ Die **Verteilung der Themen** auf die eingeschriebenen Teilnehmer erfolgt erst nach Feststellung der endgültigen Teilnehmerliste, also am 17.02.2016.