

Seminar im SoSe 2025

„Quantitative Methoden im Risikomanagement“

- Aktuelle Trends im Kontext „Nachhaltigkeit“ -

Im Seminar zum Thema „Quantitative Methoden im Risikomanagement“, das im Sommersemester 2025 in Abstimmung mit der Professur für Stochastik (FB Mathematik und Informatik) angeboten wird und darüber hinaus Gastbeiträge aus der betrieblichen Praxis zu ausgewählten Themen enthalten soll, werden Verfahren des quantitativen Risikomanagements im Kontext aktueller Fragestellungen zur Nachhaltigkeit thematisiert. Konkreter Hintergrund sind einerseits die jüngeren Entwicklungen in den aufsichtsrechtlichen Vorgaben für Banken und Versicherungen sowie andererseits Trends im Kontext der Unternehmenspublizität, die durch internationale Verlautbarungen ebenfalls zunehmend in die Nähe des finanzwirtschaftlichen (Kredit-)Risikomanagements rückt. Mit Blick auf diese Entwicklungen stehen sowohl konzeptionelle (methodische) Fragen als auch praktische Umsetzungsprobleme im Mittelpunkt der Veranstaltung.

Teilnehmerkreis:

- Studierende im B.Sc. und M.Sc. Betriebswirtschaftslehre (mit quantitativer Schwerpunktsetzung) [Wertigkeit: 6 LP]
- Studierende im M.Sc. Quantitative Accounting and Finance [Wertigkeit: 6 LP]
- Studierende im B.Sc. und M.Sc. (Wirtschafts-)Mathematik [Wertigkeit: Einbringung als WiWi-Modul mit 6 LP]

Die Leistungen im Seminar (schriftliche Ausarbeitung, Vortrag und Mitarbeit) können in **Deutsch oder Englisch** erbracht werden!

Themenliste:

1. Lifetime Expected Credit Losses: Erweiterte Verlustantizipation nach IFRS 9 – Darstellung und Würdigung
2. Erklärbarkeit von Machine Learning in der PD Bestimmung
3. ESG-Ratingagenturen – Inhalt, Entwicklung und Reichweite
4. „Green-Regulatorik“ – Der Effekt ökologischer regulatorischer Anforderungen auf die Kreditwürdigkeit
5. Integration von Umweltrisiken in Kreditrisikoprozesse
6. Repräsentativitätsanalysen von Stichproben
7. Imputierungsverfahren für PD-Modelle
8. „Importance Sampling“-Methoden zur PD- und Verlustschätzung
9. Spillover-Effekte und Systemrisiko

Organisatorische Eckdaten:

- **Anmeldung:**

Die Anmeldung ist bis zum **15. April 2025 bis 12.00 Uhr** unter Nennung Ihres Studiengangs und Ihrer Vertiefungsfächer sowie möglicher Themenpräferenzen unter **rlsek@wiwi.uni-marburg.de** möglich.

- **Themenzuteilung / Einführungsveranstaltung:**

Die **Themenzuteilung** unter Beachtung Ihres Studiengangs sowie Ihrer Vertiefungsfächer erfolgt am **22. April 2025** im Rahmen einer Einführungsveranstaltung mit dezidierten (inhaltlichen) Hinweisen und Literaturempfehlungen. Das konkrete Format der Veranstaltung wird zu gegebener Zeit bekannt gegeben.

- **Ablauf des Seminars:**

Das Seminar (Vortragsteil) findet als geblockte Präsenzveranstaltung im Juni 2025 statt. Danach besteht die Möglichkeit, die schriftlichen Ausarbeitungen (Hausarbeiten) bis Mitte September 2025 zu verfassen.

Die verpflichtende Abstimmung über die **Gliederung** der Hausarbeit auf der Basis einer ausreichenden Menge einschlägiger Literaturquellen hat mit dem/der zugewiesenen Betreuer/in bis zum **30. Mai 2025** ausgehend von den Teilnehmern/-innen zu erfolgen!

gez.
Sascha Mölls