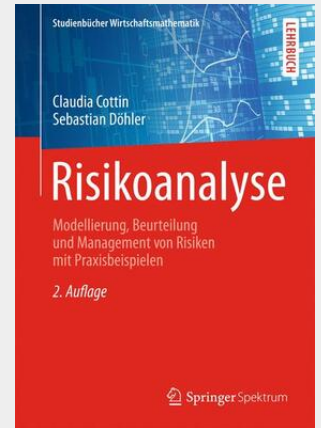


Risikoanalyse

Modellierung, Beurteilung und Management von Risiken mit Praxisbeispielen

Dieses Buch bietet eine anwendungsorientierte Darstellung mathematischer Methoden der Risikomodellierung und -analyse. Ein besonderes Anliegen ist ein übergreifender Ansatz, in dem finanz- und versicherungsmathematische Aspekte gemeinsam behandelt werden, etwa hinsichtlich Simulationsmethoden, Risikokennzahlen und Risikoaggregation. So bildet das Buch eine fundierte Grundlage für quantitativ orientiertes Risikomanagement in verschiedensten Bereichen und weckt das Verständnis für Zusammenhänge, die in spartenspezifischer Literatur oft nicht angesprochen werden. Zahlreiche Beispiele stellen immer wieder den konkreten Bezug zur Praxis her. In der 2. Auflage wurden Abschnitte über Extremwerttheorie und strukturierte Finanzprodukte (Zertifikate) ergänzt und neue Beispiele z.B. zum Asset-Liability-Management aufgenommen.

Dieses Buch bietet eine anwendungsorientierte Darstellung mathematischer Methoden der Risikomodellierung und -analyse. Ein besonderes Anliegen ist ein übergreifender Ansatz, in dem finanz- und versicherungsmathematische Aspekte gemeinsam behandelt werden, etwa hinsichtlich Simulationsmethoden, Risikokennzahlen und Risikoaggregation. So bildet das Buch eine fundierte Grundlage für quantitativ orientiertes Risikomanagement in verschiedensten Bereichen und weckt das Verständnis für Zusammenhänge, die in spartenspezifischer Literatur oft nicht angesprochen werden. Zahlreiche Beispiele stellen immer wieder den konkreten Bezug zur Praxis her. In der 2. Auflage wurden Abschnitte über Extremwerttheorie und strukturierte Finanzprodukte (Zertifikate) ergänzt und neue Beispiele z.B. zum Asset-Liability-Management aufgenommen. Der Inhalt Einführung - Mathematische Modellierung von Risiken - Risikokennzahlen und deren Anwendung - Risikoentlastungsstrategien - Abhängigkeitsmodellierung - Auswahl und Überprüfung von Modellen - Simulationsmethoden Die Zielgruppen Studierende der Wirtschaftsmathematik, Wirtschaftswissenschaften und des Wirtschaftsingenieurwesens im Bachelor- und Master-Studium Praktiker in Banken, Versicherungen, Wirtschaftsunternehmen, Beratungsfirmen Die Autoren Prof. Dr. Claudia Cottin ist Aktuarin (DAV). Sie lehrt am Fachbereich Ingenieurwissenschaften und Mathematik der FH Bielefeld. Prof. Dr. Sebastian Döhler lehrt am Fachbereich Mathematik und Naturwissenschaften der Hochschule Darmstadt.



49,99 €
46,72 € (zzgl. MwSt.)

Lieferfrist: bis zu 10 Tage

Artikelnummer: 9783658008291
Medium: Buch
ISBN: 978-3-658-00829-1
Verlag: Springer
Erscheinungstermin: 02.01.2013
Sprache(n): Deutsch
Auflage: 2. überarbeitete und erweiterte Auflage 2013
Serie: Studienbücher Wirtschaftsmathematik
Produktform: Kartoniert
Gewicht: 747 g
Seiten: 456
Format (B x H): 169 x 241 mm

