

STATISTISCHE PHYSIK VON FINANZ- UND KREDITMÄRKTEN

Vorlesung Sommersemester 2021

Professor Dr. Thomas Guhr

Die immer noch andauernde **Finanzkrise** hat viele Fragen im Bereich der **Risikomodellierung und -bewertung** aufgeworfen. So zeigte sich, dass **Marktrisiken** einzelner aber auch **korrelierter** Aktien unterschätzt werden. Besonders die Bewertung von **Kreditrisiken** ist ins allgemeine Interesse gerückt, da diese auch in engem Zusammenhang mit der **systemischen** Stabilität der Wirtschaft insgesamt stehen. In der Vorlesung soll ein Überblick zu diesem Themenkreis vermittelt werden. Gängige Modellansätze werden kritisch beleuchtet und Alternativen aufgezeigt.



Die Vorlesung ist eine Fortsetzung der **WIRTSCHAFTSPHYSIK** und vertieft einige der dort behandelten Fragestellungen. So werden wir unter anderem das Geschehen auf den Finanzmärkten “mikroskopisch” betrachten. Weitere Schwerpunkte sind das internationale Netzwerk der gegenseitigen Firmenbeteiligungen, Kreditrisiko-Modelle und agentenbasierte Modellierung eines virtuellen Marktes.

Die Vorlesung findet **vierstündig** in der **zweiten Hälfte** des Semesters statt, und zwar nach Vorlesungsverzeichnis Montags 10–12 Uhr und Dienstags 16–18 Uhr, allerdings in einem elektronischen Format, siehe MOODLE.

Der Gesamtumfang ist zwei Semesterwochenstunden.

Fragen? — E-mail an thomas.guhr@uni-due.de