

Universiteit van Pretoria Jaarboek 2017

Kwantitatiewe risikobestuur 833 (WTW 833)

Kwalifikasie	Nagraads
Fakulteit	Fakulteit Natuur- en Landbouwetenskappe
Modulekrediete	0.00
Voorvereistes	Finansiële Ingenieurswese op honneursvlak
Kontaktyd	1 lesing per week
Onderrigtaal	Module word in Engels aangebied
Akademiese organisasie	Wiskunde en Toegepaste Wisk
Aanbiedingstydperk	Jaar

Module-inhoud

*Hierdie inligting is slegs in Engels beskikbaar.

*Consult with the head of the department of Mathematics and Applied Mathematics about the availability of this master's module in a particular year.

Risk in perspective. Traditional RiskMetrics. Methods to calculate VaR. Designing scenario analyses and stress analysis. Risk measures based on loss distributions. Aggregate risk measures which include coherent risk measures. Extreme value theory. Correlation, copulas and dependence. Credit risk management.

Die inligting wat hier verskyn, is onderhewig aan verandering en kan na die publikasie van hierdie inligting gewysig word.. Die [Algemene Regulasies \(G Regulasies\)](#) is op alle fakulteite van die Universiteit van Pretoria van toepassing. Dit word vereis dat elke student volkome vertrouwd met hierdie regulasies sowel as met die inligting vervat in die [Algemene Reëls](#) sal wees. Onkunde betreffende hierdie regulasies en reëls sal nie as 'n verskoning by oortreding daarvan aangebied kan word nie.