

Ereignisrisiko

Statistische Verfahren und Konzepte zur Risikoquantifizierung

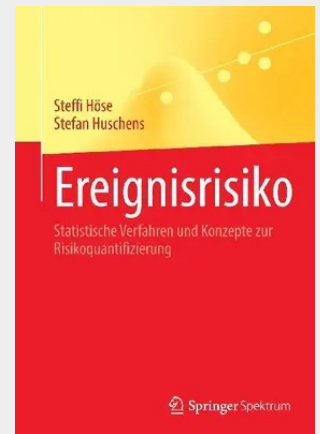
Im Fokus dieses Buches steht die quantitative Modellierung und statistische Messung von Ereignisrisiken: Es werden statistische Schätzverfahren zur Quantifizierung von Ereignisrisiken und statistische Testverfahren zum Einsatz im Rahmen der Risikokontrolle präsentiert.

Kapitelweise werden die wichtigsten Risikomaßzahlen verbal eingeführt, formal definiert, im Rahmen kurzer Beispiele für verschiedene stochastische Modelle berechnet und anschließend im Kontext verschiedener Datensituationen statistisch geschätzt. Die geschätzten Werte werden um Genauigkeitsangaben ergänzt. Statistische Testverfahren, die zum Risikomonitoring eingesetzt werden können, vervollständigen das jeweilige Kapitel.

Das statistische Vorgehen wird stets anhand von Anwendungsbeispielen veranschaulicht. Softwarehinweise in Form von Prozeduren und Funktionen für Excel, GAUSS, Mathematica und R ergänzen die jeweiligen Ausführungen. Am Ende jedes Kapitels findet sich ein kurzes Resümee, das die entscheidenden Erkenntnisse und Fallstricke prägnant zusammenfasst, sowie ein Abschnitt zu den methodischen Hintergründen und Herleitungen.

Das Buch mit seinen vielfältigen Beispielen ist interdisziplinär ausgerichtet und gut geeignet zum Selbststudium, zur Weiterbildung oder als Grundlage für Lehrmodule zur Risikomodellierung, Risikomessung, Risikoquantifizierung, zu Risikomaßen oder zum Risikomanagement in wirtschafts-, ingenieur- und naturwissenschaftlichen Studiengängen. Die Präsentation der Inhalte auf verschiedenen Schwierigkeitsstufen (datenorientierte Verfahren, methodischer Hintergrund und Herleitungen, technische Anhänge) ermöglicht den Einsatz auf verschiedenen Studienniveaus und macht das Buch auch für forschende Wissenschaftler interessant.

Im Fokus dieses Buches steht die quantitative Modellierung und statistische Messung von Ereignisrisiken: Es werden statistische Schätzverfahren zur Quantifizierung von Ereignisrisiken und statistische Testverfahren zum Einsatz im Rahmen der Risikokontrolle präsentiert. Kapitelweise werden die wichtigsten Risikomaßzahlen verbal eingeführt, formal definiert, im Rahmen kurzer Beispiele für verschiedene stochastische Modelle berechnet und anschließend im Kontext verschiedener Datensituationen statistisch geschätzt. Die geschätzten Werte werden um Genauigkeitsangaben ergänzt. Statistische Testverfahren, die zum Risikomonitoring eingesetzt werden können, vervollständigen das jeweilige Kapitel. Das statistische Vorgehen wird stets anhand von Anwendungsbeispielen veranschaulicht. Softwarehinweise in Form von Prozeduren und Funktionen für Excel, GAUSS, Mathematica und R ergänzen die jeweiligen Ausführungen. Am Ende jedes Kapitels findet sich ein kurzes Resümee, das die entscheidenden Erkenntnisse und Fallstricke prägnant zusammenfasst, sowie ein Abschnitt zu den methodischen Hintergründen und Herleitungen. Das Buch mit seinen vielfältigen Beispielen ist interdisziplinär ausgerichtet und gut geeignet zum Selbststudium, zur Weiterbildung oder als Grundlage für Lehrmodule zur Risikomodellierung, Risikomessung, Risikoquantifizierung, zu Risikomaßen oder zum Risikomanagement in wirtschafts-, ingenieur- und naturwissenschaftlichen Studiengängen. Die Präsentation der Inhalte auf verschiedenen Schwierigkeitsstufen (datenorientierte Verfahren, methodischer Hintergrund und Herleitungen, technische Anhänge) ermöglicht den Einsatz auf verschiedenen Studienniveaus und macht das Buch auch für forschende Wissenschaftler interessant.



34,99 €

32,70 € (zzgl. MwSt.)

Lieferfrist: bis zu 10 Tage

Artikelnummer: 9783662646908

Medium: Buch

ISBN: 978-3-662-64690-8

Verlag: Springer

Erscheinungstermin: 16.07.2022

Sprache(n): Deutsch

Auflage: 1. Auflage 2022

Produktform: Kartoniert

Gewicht: 552 g

Seiten: 309

Format (B x H): 168 x 240 mm

