

Masterstudiengang Risikomanagement und
Finanzanalyse (M.Sc.)

Modulangebot Sommersemester 2024

Inhalte – Lernergebnisse – Lehrende – Termine



Inhalt

Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie.....	3
Asset Liability Management.....	4
Risiko und Sustainability Alternativer Investments	5

Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie

Pflichtmodul

Lehrende*	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Im Mittelpunkt des Moduls stehen theoretische Grundlagen sowie empirische Aspekte des Portfoliomanagements und des Asset Pricing. Insbesondere werden folgende Fragen behandelt: <ul style="list-style-type: none"> — Aus welchen Elementen setzt sich der Prozess der Asset Allocation zusammen? — Nach welchen Kriterien sollten rationale Akteure am Kapitalmarkt ihre Anlageentscheidungen unter Unsicherheit treffen? — Was determiniert den Preis von am Kapitalmarkt gehandelten Finanzinstrumenten? — Wie effizient werden Informationen am Kapitalmarkt verarbeitet? Ist das Verhalten von Investoren am Kapitalmarkt mit der Annahme rationaler Akteure vereinbar? Wie lässt sich die Performance von Anlagestrategien messen und verursachungsgerecht beurteilen?
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> — Die Studierenden kennen die wesentlichen Schritte des Portfoliomanagementprozesses sowie ihre theoretischen Grundlagen. Insbesondere sind sie in der Lage, Anlageentscheidungen theoretisch konsistent abzuleiten, die Relevanz kapitalmarkttheoretischer Modelle zur Erklärung der Preisbildung am Kapitalmarkt kritisch einzuschätzen und den Erfolg von Anlagestrategien ex post zu beurteilen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 25 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	<ul style="list-style-type: none"> — regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops — Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Kreditpunkte und Noten	Kreditpunkte: 6 KP Notenskala: 1,0 / 1,3 / 1,7 / 2,0 / 2,3 / 2,7 / 3,0 / 3,3 / 3,7 / 4,0 / 5,0
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. , (internetgestützte (betreute) Selbststudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Anmeldung bis: 26.03.2024 Modulbeginn (online): 09.04.2024 Workshop I (vor Ort): 12./13.04.2024 (Fr. 15:00-19:00, Sa. 8:30-14:30) Workshop II (vor Ort): 05./06.07.2024 (Fr. 15:00-19:00, Sa. 8:30-14:30) Nachbereitungsphase und Modulabschluss (online) bis: 04.08.2024
Gebühr	900,00 Euro

Asset Liability Management

Wahlpflichtmodul (Branchenkompetenz)

Lehrende*r	Prof. Dr. Sebastian Schlütter Hochschule Mainz
Inhalte	Kapitalmarktmodelle, deterministische und stochastische Modelle für die Passivseite, Risikomaße, Risikoklassen, Sicherheitskapital, Testszenarien, Projektionsrechnung, Stresstests, wertorientierte Unternehmenssteuerung Portfoliooptimierung, auch unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsaspekten
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">— Die Studierenden lernen die Prinzipien eines gleichzeitigen Monitorings von versicherungstechnischen und finanzmathematischen Risiken kennen.— Sie können die Risikotreiber für beide Risikoarten benennen und ihre Auswirkungen auf das Unternehmensergebnis auch für fachfremde Personen beschreiben.— Sie kennen mathematische Modelle für versicherungstechnisches und finanzmathematisches Risiko und können ihre Wirkungsweise erklären.— Sie können Kennzahlen für Finanzanlagen (z.B. Duration) berechnen und interpretieren.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 25 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	<ul style="list-style-type: none">— regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops— Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Kreditpunkte und Noten	Kreditpunkte: 6 KP Notenskala: 1,0 / 1,3 / 1,7 / 2,0 / 2,3 / 2,7 / 3,0 / 3,3 / 3,7 / 4,0 / 5,0
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestützte (betreute) Selbststudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Anmeldung bis: 12.03.2024 Modulbeginn (online): 26.03.2024 Workshop I (vor Ort): 19./20.04.2024 (Fr. 15:00-19:00, Sa. 08:30-14:30) Workshop II (vor Ort): 12./13.07.2024 (Fr. 15:00-19:00, Sa. 08:30-14:30) Nachbereitungsphase und Modulabschluss (online) bis: 11.08.2024
Gebühr	900,00 Euro

Risiko und Sustainability Alternativer Investments

Wahlpflichtmodul (Aktuelle Themen)

Lehrende*r	Jegor Tokarevich SOF Ltd.
Inhalte	<p>Alternative Investments (AI) wie Private Equity, Private Debt, Infrastruktur oder Immobilien sind ein wichtiger Baustein in der Kapitalanlage von Investoren, insbesondere von Versicherern, Banken, Pensionskassen, Asset Manager*innen und Kapitalverwaltungsgesellschaften. AI sind heterogen, komplex und werfen viele multidisziplinäre Fragen an der Schnittstelle zwischen der Regulierung, dem Risikomanagement und sonstigen Prozessen auf.</p> <p>Das Modul behandelt im ersten Teil die wesentlichen Merkmale, Chancen und Risiken von Alternativen Investments als Anlageklasse insbesondere in Abgrenzung zu traditionellen Investments. Danach beschäftigen sich die Teilnehmenden mit den wesentlichen Eigenschaften und Risiken einzelner AI-Klassen, darunter Private Equity, Private Debt, Infrastruktur und Real Estate als Direkt- und (Dach-)Fondsinvestments. Dabei werden marktübliche assetspezifische Risikomanagement- und -bewertungsverfahren vor und nach dem Investment diskutiert sowie Praxisfälle vorgestellt. In diesem Kontext werden auch aktuelle Ansätze zum Management von Nachhaltigkeitsrisiken (ESG) analysiert.</p>
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> — Die Studierenden können die Vor- und Nachteile von alternativen Investments als Anlageklasse verstehen und analysieren sowie diese in das aktuelle institutionelle Investmentuniversum einordnen und von traditionellen Anlageklassen abgrenzen. — Sie sind in der Lage, Chancen und Risiken ausgewählter alternativer Investmentklassen zu identifizieren und zu evaluieren. — Die Teilnehmenden kennen die gängigen Risikomanagement- und -bewertungsverfahren, die vor und nach dem Investment in alternativen Anlageklassen eingesetzt werden, und können geeignete Verfahren für individuelle Risiken auswählen. — Darüber hinaus kennen sie den aktuellen Stand der Diskussion und verschiedene Verfahren zur Messung von Nachhaltigkeitsrisiken (ESG) und können geeignete Verfahren für relevante ESG-Risiken auswählen und weiterentwickeln. — Sie differenzieren zwischen den wesentlichen Schritten von Investmentprozessen und folgern, wie die Risikomanagementaufgaben mit dem Investmentprozess sinnvoll verknüpft werden können
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Online-Workshops
Teilnehmerzahl	max. 25 Teilnehmende
Voraussetzungen	Keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	<ul style="list-style-type: none"> — regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Online-Workshops — Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Kreditpunkte und Noten	Kreditpunkte: 6 KP Notenskala: 1,0 / 1,3 / 1,7 / 2,0 / 2,3 / 2,7 / 3,0 / 3,3 / 3,7 / 4,0 / 5,0
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. zwei Semestern angeboten.
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestützte (betreute) Selbststudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	<p>Anmeldung bis: 20.03.2024 Modulbeginn (online): 03.04.2024 Workshop I (online): 05./06.04.2024 (Fr. 15:30-19:00, Sa. 09:30-13:30) Web-Seminar I-II (online): 09./10.04.2024 (Di/Mi 18:30-20:30) Web-Seminar III-V (online): 16./17./18.04.2024 (Di/Mi/Do 18:30-20:30) Workshop II (online): 28./29.06.2024 (Fr. 15:00-19:00, Sa. 08:30-14:30) Nachbereitungsphase und Modulabschluss (online) bis: 28.07.2024</p>
Gebühr	900,00 Euro

Beratung & Kontakt

Silke Welter
Studiengangsmanagement
Risikomanagement und Finanzanalyse (M.Sc.)



BERATUNGSTERMIN VEREINBAREN

Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
C3L – Center für lebenslanges Lernen
Ammerländer Heerstraße 136
26129 Oldenburg

T +49 (0)441 / 798 32 44
F +49 (0)441 / 798 44 11
E risikomanagement@uni-oldenburg.de
www.uol.de/risikomanagement

