

Berufsbegleitender Masterstudiengang

Risikomanagement für Finanzdienstleister (M.Sc.)



Modulvorschau Sommersemester 2018

Kurzbeschreibungen der geplanten Module

www.uni-oldenburg.de/risikomanagement

Quantitative Methoden

Lehrende	Prof. Dr. Christiane Goodfellow, Jade-Hochschule Wilhelmshaven
Inhalte	Lage- und Streuungsmaße, empirische Quantile, Histogramm, rohe und geglättete empirische Verteilungsfunktion, empirische Korrelation, Ausgleichsrechnung (Regression), Zufall und Wahrscheinlichkeit, diskrete und stetige Wahrscheinlichkeitsmodelle, bedingte Wahrscheinlichkeit und Unabhängigkeit, Zufallsvariablen und ihre Verteilung, Erwartungswert, Varianz und Kovarianz, Gesetz der Großen Zahlen und zentraler Grenzwertsatz, Abhängigkeitsmaße (Korrelation und Rangkorrelation), die multivariate Normalverteilung, statistische Schätzverfahren (Momentenmethode, Maximum-Likelihood-Methode), statistische Testverfahren (Binomialtest, Gauß-Test, t-Test, Chi-Quadrat-Anpassungstest, Chi-Quadrat-Unabhängigkeitstest, Q-Q-Plot), Konfidenzintervalle.
Lernergebnisse	Erarbeitung grundlegender Methoden der Angewandten Statistik.
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen, Webinaren und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Kurzprüfung
Gebühren	900,00 Euro

Unternehmensbewertung

Lehrende	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Kapitalmarktmodelle und Kapitalmarkteffizienz, Ertragsanalyse, Berücksichtigung von Fremdkapital, Ansätze zur Kapitalkostenbestimmung, Risikozuschläge, Beta-Faktoren, Cash Flow Return on Investment, Cash Value Added, Entscheidungstheoretische Grundlagen
Lernergebnisse	Erarbeiten der quantitativen Grundlagen für eine integrierte Betrachtung des wertorientierten Managements
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Gebühren	900,00 Euro

Risikomodelle (Wahlpflichtmodul)

Lehrende	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Beschreibung und Modellierung von Risiken durch Wahrscheinlichkeitsverteilungen, das kollektive Modell der Risikotheorie, statistische Modelle für Naturgefahren und Katastrophenschäden, Grundlagen der zeitdiskreten Finanzmathematik (Aktienkursmodelle und Optionen), Risikomaße (Value at Risk, Expected Shortfall, kohärente Risikomaße), Risikoaggregation, Risikoentlastung (Rückversicherung / Finanz-Derivate), Modellierung stochastisch abhängiger Risiken.
Lernergebnisse	Erarbeitung grundlegender mathematisch-statistischer Methoden zur Modellierung und quantitativen Bewertung von Risiken.
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung
Gebühren	900,00 Euro

Informationsmanagement (Wahlpflichtmodul)

Lehrende	Prof. Dr. Jens Lüssem Fachhochschule Kiel
Inhalte	Informationssysteme für zentrale Bereiche (Vertrieb, Zahlungsverkehr, Risikomanagement (Basel II/III und Solvency II) und Gesamtkonzernsteuerung), Enterprise Architecture (EA), Service-oriented Architecture (SOA), zentrale vs. dezentrale Informationsbereitstellung, Komplexität, IT und Produktbewertung, Risikoquantifizierung, time-to-market
Lernergebnisse	Erarbeiten der Besonderheit der Informationsverarbeitung bei Banken und Versicherungen auf der Basis von Architektur-Modellen
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Fallstudien
Gebühren	900,00 Euro

Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements - Risikomanagement für alternative Investments (Wahlpflichtmodul)

Lehrende	Jegor Tokarevich Substance Over Form Ltd., London
Inhalte	Die aktuelle Niedrigzinsphase erhöht die Bedeutung von alternativen Investments für die Anlageallokation von institutionellen Investoren und ihren Finanzdienstleistern. Das Risikomanagement für diese Anlageklassen ist nicht nur eine regulatorische Notwendigkeit, sondern kann auch einen wesentlichen Wertetreiber darstellen. Im Modul „Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements - Risikomanagement für alternative Investments“ werden die Charakteristika von ausgewählten alternativen Investmentklassen wie Private Equity, Infrastruktur oder Private Debt als Direkt- und Fondsinvestments vorgestellt, die wesentlichen regulatorischen Anforderungen behandelt sowie die unterschiedlichen Prozesse entlang der Wertschöpfungskette diskutiert.
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> • Die Teilnehmenden verstehen die Vor- und Nachteile von alternativen Investments als Anlageklasse und können sie in das aktuelle institutionelle Investmentuniversum einordnen. • Sie sind in der Lage, Risiko- und Renditetreiber ausgewählter Investmentklassen zu identifizieren. • Sie können die Regulierungssystematik auf der Investor- und Investmentebene abgrenzen und die Konsequenzen herausarbeiten. • Sie können Investmentprozesse in den gängigen Strukturen analysieren und die Risikomanagementaufgaben einordnen.
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen.
Gebühren	900,00 Euro