

Masterstudiengang Risikomanagement für
Finanzdienstleister (M.Sc.)

Modulangebot Wintersemester 2021/22

Inhalte – Lernergebnisse – Lehrende – Termine



Inhalt

Finanzinstrumente	3
Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie.....	4
Ausfallrisiko und Rating.....	5
Qualitatives Risikomanagement und Behavioural Finance	6
Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements Regulierung und ESG Alternativer Investments	7

Finanzinstrumente

Pflichtmodul

Lehrende*r	Prof. Dr. Armin Varmaz Hochschule Bremen
Modulverantwortliche*r	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Im Mittelpunkt der Veranstaltung steht die Systematisierung, Diskussion und betriebswirtschaftliche Bewertung der am Kapitalmarkt beobachtbaren Formen von Finanzinstrumenten. Behandelt werden, nach einem kurzen Überblick über die Grundlagen der Finanzierungstheorie und der Finanzplanung, sowohl traditionelle Instrumente der Innen- und Außenfinanzierung von Unternehmen als auch derivative Finanzinstrumente, wie insbesondere Optionen, Futures und Swaps.
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> — Die Studierenden können verschiedene Instrumente der Unternehmensfinanzierung und des finanzwirtschaftlichen Risikomanagements unterscheiden und hinsichtlich ihrer Vor- und Nachteile kritisch beurteilen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 22 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 Präsenzphasen — Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Thesenpapier
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. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Modulbeginn: 01.10.2021 Digitale Präsenzphase I: 15.10.2021 (16.00-19.15h) Q&A Web-Seminare: 02.11.2021 / 23.11.2021 (18.30-20.00h) Digitale Präsenzphase II: 10.12.2021 (16.00-19.15h) Q&A Web-Seminare: 11.01.2022 / 01.02.2022 (18.30-20.00h) Nachbereitungsphase und Modulabschluss bis: 27.02.2022
Gebühr	900,00 Euro

Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie

Pflichtmodul

Lehrende*r	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortliche*r	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Im Mittelpunkt der Veranstaltung 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. 22 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 Präsenzphasen — 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. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Modulbeginn: 09.11.2021 Digitale Präsenzphase I: 12./13.11.2021 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Digitale Präsenzphase II: 25./26.02.2022 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Nachbereitungsphase und Modulabschluss bis: 10.04.2022
Gebühr	900,00 Euro

Ausfallrisiko und Rating

Auswirkungen der COVID-Krise auf die Modellierung, Messung und Steuerung des Kreditrisikos

Wahlpflichtmodul

Lehrende*r	Dr. Giles-Arnaud Nzouankeu Nana. Creditplus Bank AG
Modulverantwortliche*r	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	<p>Die Veranstaltung gibt eine detaillierte Einführung in für Banken und Versicherungen wesentliche Aspekte des Managements von Ausfallrisiken und Kreditrisiken. Es werden Modellierungsverfahren für Einzel- und Portfoliokreditrisiken vorgestellt und die Konstruktion und der Einsatz von Kreditderivaten diskutiert. Die bilanzielle Behandlung von Kreditrisiken, welche einen wichtigen Einfluss auf die Risikosteuerung hat, wird auch vorgestellt und diskutiert. Darüber hinaus werden Ratingverfahren und das regulatorische Umfeld (Basel II/III, Solvency II) ausführlich thematisiert.</p> <p>Die Auswirkungen der COVID-Krise auf die Modellierung, Messung und Steuerung des Kreditrisikos wird ausführlich thematisiert und diskutiert. Dabei werden sowohl die seit dem Beginn der COVID-Krise veröffentlichten regulatorischen und gesetzlichen Anforderungen (von der EBA, EZB, Bundesregierung, ...) für die Behandlung der COVID betroffenen Bankkunden und ihre aktuellen Einflüsse auf die Messung und den Risikovorsorgeprozess als auch die zukünftigen Auswirkungen auf die Modellierung von Ratingssystemen (auf die Antrags-Scorekarten und auf die Verhaltens-Scorekarten) untersucht. Zusätzlich werden auch statistische Modelle zur Schätzung der COVID-Effekte vorgestellt und diskutiert.</p>
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> — Die Teilnehmenden können Ausfallrisiken und Kreditrisiken von Finanzinstrumenten bzw. Kontraktpartnern quantitativ bewerten. — Sie können die Rolle und Aussagekraft von Ratings einschätzen und aktuelle regulatorische Entwicklungen vor diesem Hintergrund kritisch beurteilen. — Zusätzlich können sie die aktuellen und zukünftigen Auswirkungen der COVID-Krise auf die Finanzunternehmen (insb. auf das Kreditrisiko) besser beurteilen und modellieren.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 22 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 Präsenzphasen — Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Thesenpapier
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. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	<p>Modulbeginn: 18.10.2021</p> <p>Web-Seminare: 05./06.11.2021 (Fr 16.30-19.15h, Sa 8.30-12.00h) 03./04.12.2021 (Fr 16.30-19.15h, Sa 8.30-12.00h) 14./15.01.2022 (Fr 16.30-19.15h, Sa 8.30-12.00h) 11./12.02.2022 (Fr 16.30-19.15h, Sa 8.30-12.00h)</p> <p>Nachbereitungsphase und Modulabschluss bis: 13.03.2022</p>
Gebühr	900,00 Euro

Qualitatives Risikomanagement und Behavioural Finance

Wahlpflichtmodul

Lehrende*r	Prof. em. Dr. Karl Lohmann Oldenburg
Modulverantwortliche*r	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	<p>Aufbauend auf den Inhalten der Veranstaltung „Regulierung von Finanzdienstleistern“ behandelt Teil eins des Moduls vertieft qualitative ökonomische und juristische Aspekte des Risikomanagements. Hierzu zählen beispielsweise die betreffenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben nach Basel III bzw. Solvency II, Grundsätze einer Corporate Governance, Ausgewählte Aspekte der Risikoanalyse und -steuerung, Prinzipien eines integrierten Risikomanagements sowie aktuelle aufsichtsrechtliche Entwicklungen.</p> <p>Teil zwei des Moduls widmet sich der Bedeutung verhaltenswissenschaftlicher Erkenntnisse für das Risikomanagement von Finanzdienstleistern. Es werden typische Präferenzstrukturen und Verhaltensmuster von Individuen in Entscheidungssituationen aufgezeigt, die im Widerspruch zum vielen ökonomischen Entscheidungsmodellen zugrunde liegenden Rationalitätspostulat stehen. Zudem werden die Konsequenzen dieser Erkenntnisse für das bank- und versicherungsbetriebliche Risikomanagement anhand konkreter Fallstudien diskutiert.</p>
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> — Die Studierenden kennen die Prinzipien eines Risikomanagements auf ökonomisch-methodischer und juristischer Grundlage. — Sie können die Grenzen ökonomischer (Gleichgewichts-)Modelle vor dem Hintergrund verhaltenswissenschaftlicher Erkenntnisse kritisch reflektieren. — Sie sind darüber hinaus in der Lage, typische Formen irrationalen Verhaltens von Individuen zu benennen und die praktischen Implikationen dieser Verhaltensmuster für das Risikomanagement von Finanzdienstleistern realistisch einzuschätzen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 22 Teilnehmende
Voraussetzungen	Keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	<ul style="list-style-type: none"> — regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen — 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. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Modulbeginn: 19.10.2021 Präsenzphase I: 19./20.11.2021 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Präsenzphase II: 04./05.03.2022 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Nachbereitungsphase und Modulabschluss bis: 24.04.2022
Gebühr	900,00 Euro

Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements Regulierung und ESG Alternativer Investments

Wahlpflichtmodul

Lehrende*r	Dr. Jegor Tokarevich, SOF Ltd.
Modulverantwortliche*r	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
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 Managern und Kapitalverwaltungsgesellschaften. AI sind heterogen, komplex und werfen viele multidisziplinären Fragen an der Schnittstelle zwischen der Regulierung, dem Risikomanagement und sonstigen Prozessen auf.</p> <p>Die Veranstaltung behandelt die aktuellen regulatorischen Themenkomplexe (Solvency II, Solvency I, Basel, AIFMD) mit dem Fokus auf die Spezifika von wesentlichen AI-Klassen, darunter Private Equity, Private Debt, Infrastruktur und Real Estate als Direkt- und (Dach-)Fondsinvestments. Es werden regulatorische Kapitalanforderungen, Investment- und Risikomanagementprozesse (Prudent Person Principle) sowie Reporting diskutiert. In diesem Zusammenhang werden auch die Charakteristika von typischen Allinvestmentstrukturen z.B. über Alternative Investmentfonds (AIF) oder Verbriefungsvehikel sowie den damit verbundenen Dienstleistern (z.B. Kapitalverwaltungsgesellschaft, Anlageberater, Verwahrstelle). Ebenso wird der aktuelle Stand von Anforderungen an das Management von Nachhaltigkeitsrisiken (ESG) beleuchtet.</p>
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> — Die Studierenden können den aktuellen Stand der Regulierungsgrundlagen (Solvency II, Solvency I, Basel, AIFMD) für die wesentlichen regulierten institutionellen Investorengruppen (Versicherer, Banken, Pensionskassen, Asset Managern und Kapitalverwaltungsgesellschaften) einordnen und vergleichen. — Sie verstehen die wesentlichen Anforderungen in verschiedenen Regulierungsrahmenwerken in Bezug auf die Alternativen Investments und können geeignete Prozesse vor und nach der Investmententscheidung im Einklang mit den relevanten Anforderungen auswählen. — Die Teilnehmenden können die unterschiedlichen Vehikel und Ansätze für die Investition in Alternative Investments unter Beachtung von regulatorischen Anforderungen vergleichen und die geeigneten Vehikel je nach Anforderung begründet auswählen. — Darüber hinaus kennen sie den aktuellen Stand der Diskussion in Bezug auf die Anforderungen zum Management von Nachhaltigkeitsrisiken (ESG) und können die unterschiedlichen regulatorischen Initiativen vergleichen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 22 Teilnehmende
Voraussetzungen	Keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	<ul style="list-style-type: none"> — regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen — 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. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Modulbeginn: 23.11.2021 Präsenzphase I: 26./27.11.2021 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Präsenzphase II: 11./12.03.2022 (Fr. 15.00-19.00h, Sa. 8.30-14.30h) Web-Seminare: 30.11/01.12.2021 (18.30-20.30h) Nachbereitungsphase und Modulabschluss bis: 03.04.2022
Gebühr	900,00 Euro

Beratung & Kontakt

Silke Welter
Studiengangsmanagement
Risikomanagement für Finanzdienstleister (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/c3l

