

## Portfolio- und Kapitalmarkttheorie (rmf 160)

<b>Lehrende</b>	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl-von-Ossietzky Universität Oldenburg
<b>Modulverantwortliche</b>	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl-von-Ossietzky Universität Oldenburg
<b>Inhalte</b>	<p>Gegenstand der Veranstaltung ist die Theorie des Wertpapiermanagements. Ausgehend von den Grundmodellen der „modernen“ Portfolio- und Kapitalmarkttheorie werden vor allem Fragen folgender Art behandelt:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Nach welchen Kriterien sollten rationale Akteure am Kapitalmarkt ihre Anlageentscheidungen unter Unsicherheit treffen?</li> <li>• Was determiniert den Preis der am Kapitalmarkt gehandelten Finanzinstrumente?</li> <li>• Welche Auswirkungen haben unterschiedliche Risikopräferenzen und Anlagehorizonte auf die Anlageentscheidung?</li> </ul> <p>Nach einer Einführung in den Prozess der Asset Allocation liegt der Schwerpunkt der Veranstaltung auf der Diskussion verschiedener Verfahren der Wertpapieranalyse und des Wertpapiermanagements. Im Vordergrund steht hierbei die Beschäftigung mit der Bewertung und dem Management von Aktienportfolios. Den Abschluss bilden Überlegungen zu ausgewählten Aspekten der Performance-Messung und der Performance-Attribution.</p>
<b>Lernergebnisse</b>	Das Modul soll den Studierenden die theoretischen Grundlagen des Portfoliomanagements vermitteln. Insbesondere soll es sie befähigen, Anlageentscheidungen theoretisch konsistent abzuleiten und den Erfolg von Anlagestrategien ex post zu beurteilen.
<b>Lehrformen</b>	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
<b>Teilnehmerzahl</b>	max. 20 Teilnehmende
<b>Voraussetzungen</b>	Quantitative Methoden
<b>Verwendbarkeit des Moduls</b>	Pflichtmodul
<b>Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten</b>	regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Hausarbeit
<b>Kreditpunkte und Noten</b>	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
<b>Häufigkeit des Angebots</b>	Das Modul wird in einem Turnus von vier Semestern angeboten.
<b>Arbeitsaufwand</b>	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
<b>Dauer</b>	ca. 20 Wochen
<b>Termine</b>	Zur Zeit liegen keine Termine vor
<b>Gebühren</b>	900,00 Euro