

Berufsbegleitender Masterstudiengang
Risikomanagement für Finanzdienstleister (M.Sc.)



Modulhandbuch

Kurzbeschreibungen aller Module

www.uni-oldenburg.de/risikomanagement

Quantitative Methoden

Pflichtmodul

Lehrende	Prof. Dr. Christiane Goodfellow Jade-Hochschule Wilhelmshaven
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Das Modul bietet eine grundlegende Einführung in die Angewandte Statistik. Behandelt werden 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	<ul style="list-style-type: none">▪ Die Teilnehmenden lernen die allgemeinen Konzepte statistischer Verfahren kennen.▪ Sie können entsprechende Anwendungen der Verfahren und Konzepte in praktischen Aufgabenstellungen reproduzieren.▪ Sie erlernen die korrekte Durchführung der Verfahren in Datenbeispielen und sind in der Lage, statistische Analysen zu verstehen, kritisch zu hinterfragen und für ein gegebenes Problem ein geeignetes Verfahren auszuwählen und anzuwenden.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen, Webinaren und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von zwei Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Regulierung von Finanzdienstleistern

Pflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Stefan Janßen Jade-Hochschule Wilhelmshaven
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Im Mittelpunkt der Veranstaltung steht die Regulierung von Banken, Versicherungsunternehmen und Finanzdienstleistungen im nationalen und internationalen Kontext. Behandelt werden insbesondere das Basel III-Regelwerk und die Solvency II-Richtlinie, deren nationale Umsetzung (z.B. MaRisk BA und MaGo) sowie die Auswirkungen der aufsichtsrechtlichen Anforderungen auf das bank- bzw. versicherungsbetriebliche Risikomanagement und die Unternehmenssteuerung (z.B. in Bezug auf Risikotragfähigkeit, Risikomodelle, Risikokultur, Berichtspflichten oder Kompetenzen (fit and proper)). Im Rahmen des internetgestützten Selbststudiums arbeiten die Studierenden sich allein oder in Kleingruppen eigenständig in eine ausgewählte aufsichtsrechtliche Fragestellung ein und können ihre Ergebnisse im Rahmen der zweiten Präsenzphase präsentieren.
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">▪ Die Studierenden kennen wesentliche aufsichtsrechtliche Rahmenbedingungen des Finanzsektors und können aktuelle regulatorische Entwicklungen im Finanzsektor kritisch beurteilen.▪ Sie verfügen über vertiefte Kenntnisse in einem speziellen Bereich des Aufsichtsrechts und sind in der Lage, diese anschaulich und kompetent zu präsentieren.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von zwei Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Monte Carlo Methoden

Pflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Algorithmen für Standard-Zufallszahlen, Erzeugung von Zufallszahlen mit vorgegebener Verteilung (Inversionsmethode, Verwerfungsmethode, Kompositionsmethode), Erzeugung von Zufallsvektoren mit mehrdimensionaler Struktur (multivariate Normalverteilung, Copulas), interne Unternehmensmodelle.
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">Die Studierenden sind in der Lage, selbständig simulative Risikostudien zu erstellen und Ergebnisse solcher Rechnungen mit Experten auf Augenhöhe zu diskutieren sowie gegebenenfalls auch kritisch zu hinterfragen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und PräsenzphasenBestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Kurzprüfung oder Kurzklausur
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Quantitatives Risikomanagement

Pflichtmodul

Lehrende	Dr. Daniel Dubischar Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Empirische Bestimmung von Risikomaßen und Risikokennzahlen, wertorientiertes Risikomanagement, mathematische Grundlagen von Eigenmittelanforderungen nach Basel II/III und Solvency II, Korrelation und Diversifikation, mathematische Methoden der Risikokapitalallokation
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Die Studierenden kennen die wesentlichen Risikoklassen für die verschiedenen Finanzintermediäre und können sie im Hinblick auf nationales und internationales Aufsichtsrecht einschätzen. ▪ Sie kennen statistische Risikomaße, können deren Vor- und Nachteile beschreiben und ihre Auswirkung auf die Eigenkapitalunterlegung für das Unternehmen angeben. ▪ Sie sind mit Abhängigkeitskonzepten für Finanz- und Versicherungsportfolios vertraut und können diese mathematisch beschreiben und statistisch mit Excel oder R an Daten anpassen. ▪ Die Grundlagen der wertorientierten Unternehmenssteuerung und gängige Konzepte für Kapitalallokation sind den Studierenden bekannt und können in einer konkreten Risikosituation ausgerechnet werden.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none"> ▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen ▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online Aufgaben und Kurzreferat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Finanzinstrumente

Pflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Armin Varmaz Hochschule Bremen
Modulverantwortlicher	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. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und PräsenzphasenBestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzklausur oder Kurzreferat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Spezielle Themen des Risikomanagements - Extremwert- und Operationelle Risiken

Pflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Dietmar Pfeifer Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Extremwertverteilungen und ihre Herleitung (Fréchet-, Gumbel- und Weibullverteilung), statistische Verfahren zur Schätzung des Tail-Index, Hill-Plots, Grundzüge der geophysikalischen Naturgefahrenmodelle (Event Loss Table, AEP- und OEP-Kurven), Definition und Abgrenzung operationeller Risiken, aufsichtsrechtliche Anforderungen (Basel II/III, Solvency II, MA Risk BA und VA), Grundzüge der diskreten stochastischen Finanzmathematik (Optionen und Derivate, Arbitrage und Hedging, das Cox-Ross-Rubinstein-Modell).
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Die Studierenden sind mit aktuellen, vertiefenden Themen des Risikomanagements vertraut, die über die Inhalte der anderen Module des Studiengangs hinausgehen. ▪ Insbesondere kennen sie Extremrisiken, wie sie bei Naturgefahren im Versicherungsbereich auftreten, operationale Risiken, die in allen Bereichen der Finanzdienstleistung von besonderer Bedeutung sind, sowie elementare Grundlagen der stochastischen Finanzmathematik. ▪ Die Studierenden können Methoden zur Bewertung von Extremrisiken sicher und selbständig anwenden. ▪ Sie kennen die Bedeutung von Optionen und Derivaten zum Hedgen von Portfolios, erkennen deren spekulative Gefahren und beherrschen ihre Handhabung.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none"> ▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen ▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Kurzprüfung oder Kurzklausur
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

R -- Software und Tools für Financial Data Analytics

Pflichtmodul

Lehrende	Dr. Lena Reh
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	<ol style="list-style-type: none"> 1. Grundlagen in R: Was ist R, Lizenzfragen, Hilfe zur Selbsthilfe, Paketsystem, Arbeit mit R-Studio, shiny apps, reports mit knitR 2. Datentypen (parallel zu Mess-Skalen bei Fr. Goodfellow): Datenimport, Variablen: Vektoren & Listen, Indizierung; Aufruf von Funktionen / Argument-Matching 3. Graphik in R / Grundsystem: devices, High-/Low-Level; ggplot und Pradigmen 4. Explorative Datenanalyse und Simulation in R: table, summary, hist, quantile, ecdf, cov, var, cor, sd, mean, mad, median, Verteilungen in R: [r,d,p,q]<norm>, <pois>, ...; Simulation: seed einfache Simulationsstudien, Bootstrap 5. Testen und Schätzen in R: Grenzwertsätze in Aktion: Illustration von LLN und CLT, ML-Schätzung in R, Momenten/Minimum-Distanz Schätzer, Tests in R: Gaußtest, t.test, var.test, cor.test, ks.test, chi^2 Test; Struktur Output; Konfidenzintervalle in R: Bootstrap und Simulation 6. Regression und GLMs in R: Modellformulierung in R, Rückgabestruktur von lm(), Interpretation Output, Formulierung eines GLM, Diagnostik 7. Etwas Programmierung: Kontrollstrukturen, eigene Funktionen in R, For-Schleifen und deren Vermeidung; eigene Datenstrukturen (S3-Methoden), Integration von kompiliertem Code 8. Nachhaltige Software: Erstellung von R-Manuals mit Roxygen, Speichern von Analysen in (Jupyter) Notebooks, Vignetten, Einsatz von Versionierungstools/git 9. Anbindung nach "außen": Interfaces zu Datenbanken, R und Parallelisierung / auf dem Cluster
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> Die Teilnehmenden sammeln praktische Erfahrung mit der Umsetzung grundlegender Methoden der Angewandten Statistik am Rechner; dies ist grundlegend für eigenständige statistische Datenanalysen im Finanzbereich. Dazu beherrschen Sie das in R zur Verfügung stehende Grund-Instrumentarium und können dieses bei Bedarf durch Eigenrecherche mit Ergänzungsinfrastruktur erweitern und diese anschließend verwenden. Sie können Daten aus verschiedenen Quellen importieren (Datenbanken/Excel/Inhouse-Formate). Sie können die grundlegenden Konzepte aus dem Modul Quantitative Methoden in R umsetzen und kritisch hinterfragen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none"> regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Hausarbeit (längere Programmieraufgabe in Gruppen)
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. zwei Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie

Pflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	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. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none"> ▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen ▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzklausur
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Unternehmensbewertung und –finanzierung

Pflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Gegenstand des Moduls ist die Behandlung gängiger Methoden der Unternehmensbewertung und ihrer theoretischen Grundlagen. Schwerpunkte liegen auf der Diskussion kapitalwertbasierter Bewertungsverfahren, auf der Prognose künftiger Zahlungsüberschüsse sowie auf der Bestimmung risikoadjustierter Kapitalkosten mithilfe von Kapitalmarktmodellen. Darüber hinaus wird diskutiert, unter welchen Bedingungen sich Finanzierungs- und Ausschüttungsentscheidungen von Unternehmen auf den Unternehmenswert auswirken und welche Handlungsempfehlungen daraus resultieren.
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">Die Studierenden kennen die theoretischen Grundlagen, Möglichkeiten und Grenzen gängiger Unternehmensbewertungsmethoden. Sie sind in der Lage, die Auswirkungen von ihm Rahmen der Bewertung getroffenen Modellierungsentscheidungen auf das Bewertungsergebnis einzuschätzen und deren Plausibilität kritisch zu hinterfragen. Sie sind zudem vertraut mit grundlegenden Theorien zur Erklärung von Kapitalstruktur- und Ausschüttungsentscheidungen von Unternehmen sowie mit diesbezüglichen empirischen Forschungsergebnissen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und PräsenzphasenBestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzklausur
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Risikokommunikation

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Dr. Andreas Blomenkamp Mediation Andreas Blomenkamp, Oldenburg
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Allgemeine Kommunikationstheorie Besonderheiten der Risikokommunikation Interne und externe Risikokommunikation Krisenkommunikation Reflexion des eigenen Kommunikationsverhaltens
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">▪ Die Studierenden erwerben ein vertieftes Verständnis für Kommunikationsprozesse.▪ Sie kennen adressatengerechte Kommunikationskonzepte und können sie anwenden.▪ Insbesondere sind sie gegenüber spezifischen Kommunikationsfallen des Risikomanagements sensibilisiert und haben ein Verständnis für Kommunikationsstrategien in Krisen entwickelt.▪ Darüber hinaus gelingt ihnen der Transfer des Erlernten auf die eigene berufliche Praxis.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Hausarbeit
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Risikomodelle - Risiken in der Versicherung

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Marcus Christiansen Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Marcus Christiansen Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Beschreibung und Modellierung von Versicherungsrisiken durch Wahrscheinlichkeitsmodelle, Ausgleich im Kollektiv, Äquivalenzprämien und Deckungsrückstellungen in der Personenversicherung (Lebens- und Krankenversicherung), individuelles und kollektives Modell der Risikotheorie, Prämien differenzierung und Spätschadenreserven in der Sachversicherung, Formen und Zielsetzungen der Risikoteilung (proportionale und nicht-proportionale Rückversicherung).
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">Die Studierenden verstehen die stochastischen Grundlagen der Personen-, Sach-, Rückversicherungsmathematik und der Finanzmathematik und können aktuarielle Berechnungen von Experten dazu dem Grunde nach nachvollziehen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und PräsenzphasenBestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Kurzprüfung oder Kurzklausur
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Ausfallrisiko und Rating

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Die Veranstaltung gibt eine detaillierte Einführung in für Banken und Versicherungen wesentliche Aspekte des Managements von Ausfallrisiken, wobei der Schwerpunkt auf der Behandlung von Kreditrisiken liegt. Es werden Modellierungsverfahren für Einzel- und Portfoliokreditrisiken vorgestellt und die Konstruktion und der Einsatz von Kreditderivaten diskutiert. Darüber hinaus werden Ratingverfahren, das regulatorische Umfeld (Basel II/III, Solvency II) sowie die Rolle von Ratingagenturen in diesem Kontext ausführlich thematisiert
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">▪ Die Studierenden können Ausfallrisiken von Finanzinstrumenten bzw. Kontraktpartnern quantitativ bewerten.▪ Sie können die Rolle und Aussagekraft von Ratings einschätzen und aktuelle regulatorische Entwicklungen vor diesem Hintergrund kritisch beurteilen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzklausur oder mündliche Kurzprüfung
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Informationsmanagement

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Jens Lüssem Fachhochschule Kiel
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
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	<ul style="list-style-type: none">▪ Die Studierenden kennen Grundlegendes über die Informationsverarbeitung bei Banken und Versicherungen und können dieses Wissen in die Risikomodellierung und Risikokommunikation einfließen lassen.▪ Sie verstehen Architekturmodelle im Kontext des Handelsraums (Banken) und der Rechenkerne für ein Asset-Liability Management (Versicherungen) und lernen bei der Datenanalyse darauf Rücksicht zu nehmen.▪ Die Teilnehmenden lernen, dass die unternehmensinterne IT- und Datenorganisation wesentliche Auswirkungen auf das Risikomanagement hat und können das geforderte Reporting (gegenüber der Unternehmensführung und den Aufsichtsbehörden) dazu passend entwickeln und umsetzen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Kurzprüfung
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Asset Liability Management

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Sebastian Schlütter Hochschule Mainz
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Kapitalmarktmodelle, deterministische und stochastische Modelle für die Passivseite, Risikomaße, Risikoklassen, Sicherheitskapital, Testszenarien, Projektionsrechnung, Stresstests, wertorientierte Unternehmenssteuerung
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 (zB Duration) berechnen und interpretieren.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Quantitative Methoden
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Fallstudie und mündliche Kurzprüfung oder Kurzklausur
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements

Wahlpflichtmodul

Lehrende	wechselnde Dozenten
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Angelika May Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	je nach gewähltem Thema
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">▪ Die Studierenden erwerben Spezialwissen über ein aktuelles Thema des Risikomanagements.▪ Sie lernen neues Methodenwissen und können dieses zur Bewältigung anstehender, gegebenenfalls neu aufgetretener Probleme des Risikomanagements nutzbar machen.▪ Sie haben die Fähigkeit, sich Wissen über neue Methoden oder neue Verlautbarungen der Aufsicht selbständig zu erwerben.▪ Sie können dieses Wissen für den Einsatz in der Praxis aufarbeiten und anderen Fachleuten oder der Leitungsebene verfügbar machen.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: je nach gewähltem Thema
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Finanzintermediation

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Im Mittelpunkt der Veranstaltung steht die Vermittlung institutioneller Grundlagen des Finanzsektors. Es wird insbesondere diskutiert, welche Formen von Intermediären am Finanzmarkt anzutreffen sind, wie ihre Existenz ökonomisch begründet werden kann, welchen Anreizkonflikten sie ausgesetzt sind und welche einzel- und gesamtwirtschaftlichen Risiken mit ihren Aktivitäten verbunden sind. Neben "klassischen" Kreditinstituten und Versicherungen werden auch andere Akteure, wie etwa Finanzanalysten, Ratingagenturen oder FinTech-Unternehmen Gegenstand der Diskussion sein.
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Die Studierenden können die Existenz von Banken, Versicherungen und anderen Finanzintermediären am Kapitalmarkt anhand informations- und institutionenökonomischer Argumente begründen. ▪ Sie kennen verschiedene Theorien zur Erklärung des Verhaltens ökonomischer Akteure und können sie voneinander abgrenzen. ▪ Sie kennen wesentliche institutionelle Rahmenbedingungen des Bank- und Versicherungsgeschäfts und sind in der Lage, aktuelle Entwicklungen im Finanzsektor vor dem Hintergrund ökonomischer Theorien kritisch zu reflektieren. ▪ Sie können die Funktionen der verschiedenen Finanzintermediäre beschreiben und die damit verbundenen Risiken beurteilen. ▪ Sie sind mit typischen empirischen Forschungsdesigns in Bezug auf die Eigenschaften, die Bedeutung und das Verhalten von Finanzintermediären vertraut.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none"> ▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen ▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Accounting und Corporate Governance

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Jan-Hendrik Meier Fachhochschule Kiel
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Jörg Prokop Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	Einführung Theoretische Grundlagen Corporate Governance Mechanismen Corporate Governance und externe Rechnungslegung Corporate Governance und Kontrolle
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none">Die Studierenden kennen die zentralen Begriffe und Problembereiche der Corporate Governance und können das erworbene Wissen auf praktische Problemstellungen anwenden.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und PräsenzphasenBestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzreferat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Qualitatives Risikomanagement und Behavioural Finance

Wahlpflichtmodul

Lehrender	Prof. em. Dr. Karl Lohmann Oldenburg
Modulverantwortlicher	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. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none">▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Financial Data Analytics mit R: Methoden und Anwendungen

Wahlflichtmodul

Lehrender	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Modulverantwortlicher	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	<p>*multivariate Verfahren: Hauptkomponentenanalyse / Dimensionsreduktion, Diskriminanzanalyse & Klassifikation, Clustering, Multidimensional Scaling</p> <p>* Techniken des maschinellen Lernens: Modellwahl und Regularisierung (Lasso, elasticnet, Kreuzvalidierung), Bagging Boosting. Klassifikationsbäume , Random Forest, Einstieg in TensorFlow, Einstieg in Text Mining</p> <p>* Zeitreihen und prädiktive Modelle R für Finanzdienstleister:</p> <ul style="list-style-type: none"> • R verbinden mit anderer IT-Infrastruktur (R & Excel, R & Datenbanken, das R Bloomberg-package.) • Infrastruktur für R in Finanzanwendungen (Verarbeitung von Zeitangaben, Rmetrics; R für die Versicherung: actuar, ChainLadder; Pakete zur Portfolio Optimierung) • Parametrische Volatilitätsmodellierung in R (GARCHmodellierung in R; Quantifikation des Vorhersagefehlers; Parametrische Value at Risk Berechnung) • Zinsmodelle / Fixed Income (Modelle für die Zinsstrukturkurve in R; Zinsderivate in R; die RQuantLib Bibliothek) • Risikomanagement (Berechnung des Value at Risk und des Expected Shortfall in R; er Verlustverteilungsansatz in R; Abhängigkeiten / Copulas in R; Kreditrisiko in R)
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Die Teilnehmenden sammeln praktische Erfahrung im Umgang mit statistischen Datenanalysen im Finanzbereich. Insbesondere können sie Daten aus verschiedenen Quellen importieren (Datenbanken/Excel/Inhouse-Formate). Mit Hilfe von Simulationsstudien können Sie Risikokennziffern kritisch beurteilen und dadurch Reports mit statistischen Auswertungen für das regelmäßige Meldewesen in standardisierter Form verfassen. Darüber hinaus können sie Ergänzungsinfrastruktur zu R eigenständig auffinden und verwenden.
Lehrformen	Internetgestütztes Studium (Einzel und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Keine
Verwendbarkeit des Moduls	Wahlflichtmodul
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none"> ▪ regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen ▪ Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Projektarbeit
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 180 Std. (internetgestütztes, betreutes Selbststudium: ca. 80 Stunden, vertiefendes Selbststudium: ca. 80 Std.; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	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
Dauer	ca. 20 Wochen
Termine	Termine entnehmen Sie bitte den aktuellen Semesterübersichten
Gebühren	900,00 Euro

Masterabschlussmodul

Pflichtmodul, dieses Modul flankiert die Erstellung der Masterarbeit.

Lehrende	Dozententeam
Modulverantwortliche	Prof. Dr. Angelika May, Prof. Dr. Dietmar Pfeifer, Prof. Dr. Jörg Prokop, Prof. Dr. Peter Ruckdeschel Carl von Ossietzky Universität Oldenburg
Inhalte	<p>Ziel des Master-Moduls ist die Vorbereitung und Erstellung der Masterarbeit. Das Master-Modul besteht aus den folgenden drei Teilen: 1. Internetgestütztes Online-Kolloquium mit Mentorenbetreuung, 2. Individuelle Betreuung durch eine/n Gutachter/in des Masterstudiengangs, 3. Abschließendes Kolloquium zur Vorstellung der Masterarbeit mit anschließender Diskussion.</p> <p>Im Laufe des Online-Kolloquiums legen die Studierenden ein Exposé der geplanten Themenstellung ihrer Masterarbeit vor. Im Rahmen einer internetgestützten Diskussionsphase stellen sie ihr Exposé bzw. eine Fragestellung der Arbeit zur Diskussion. Teilnehmer/innen, Gutachter/innen und Mentor/in geben dazu Feedback.</p>
Lernergebnisse	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Die Studierenden führen selbstständig eine fortgeschrittene quantitative Untersuchung durch und stellen die Ergebnisse adäquat dar. ▪ Sie können eine praxisbezogene Fragestellung eigenständig durchdringen, angemessene quantitative Methoden einsetzen sowie über die Probleme in einer verständlichen und überzeugenden Darstellung reflektieren. ▪ Sie sind in der Lage eine Master-Abschlussarbeit selbstständig unter Nutzung wissenschaftlicher Modelle und Methoden zu erstellen. ▪ Sie haben Kenntnis der inhaltlichen und formalen Kriterien an eine wissenschaftliche Abschlussarbeit und können diese anwenden.
Lehrformen	Selbststudium , Online-Kolloquium, Abschlusskolloquium
Teilnehmerzahl	max. 20 Teilnehmende
Voraussetzungen	Prüfungsleistungen in einem Umfang von mindestens 48 KP.
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul, dieses Modul flankiert die Erstellung der Masterarbeit.
Voraussetzung für Vergabe von Leistungspunkten	<ul style="list-style-type: none"> ▪ regelmäßige Teilnahme an den Online-Diskussionen im Master-Kolloquium ▪ Erstellung eines Exposés zum Vorhaben der Masterarbeit ▪ eigenständige Anfertigung der Masterarbeit unter Anwendung wissenschaftlicher Methoden ▪ erfolgreiche Präsentation der Abschlussarbeit
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 720 Std.
Häufigkeit des Angebots	Das Master-Modul wird fortlaufend in jedem Semester angeboten.
Kreditpunkte und Notenskala	Kreditpunkte: 24 KP (Online-Kolloquium: 2 KP, Masterarbeit: 20 KP, Abschlusskolloquium: 2 KP) Notenskala: 1,0 / 1,3 / 1,7 / 2,0 / 2,3 / 2,7 / 3,0 / 3,3 / 3,7 / 4,0 / 5,0
Dauer	/
Termine	laufend
Gebühren	900,00 Euro