

Masterstudiengang Risikomanagement für
Finanzdienstleister (M.Sc.)

Modulvorschau Sommersemester 2023

Inhalte – Lernergebnisse – Lehrende



Inhalt

Regulierung von Finanzdienstleistern	3
Asset Liability Management	4
Financial Data Analytics mit R: Methoden und Anwendungen	5
Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements Risiko und Sustainability Alternativer Investments	6
Masterabschlussmodul	7

Regulierung von Finanzdienstleistern

Pflichtmodul

Lehrende*r	Prof. Dr. Stefan Janßen Jade-Hochschule Wilhelmshaven
Modulverantwortliche*r	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. 22 Teilnehmende
Voraussetzungen	Keine
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 zwei 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	Bitte entnehmen Sie die Termine dem aktuellen Semesterkatalog
Gebühr	900,00 Euro

Asset Liability Management

Wahlpflichtmodul

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
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. 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: Fallstudie und mündliche Prüfung oder Klausur
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	Bitte entnehmen Sie die Termine dem aktuellen Semesterkatalog
Gebühr	900,00 Euro

Financial Data Analytics mit R: Methoden und Anwendungen

Wahlpflichtmodul

Lehrende*r	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 <p>(Verarbeitung von Zeitangaben, Rmetrics; R für die Versicherung: actuar, ChainLadder; Pakete zur Portfolio Optimierung)</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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. 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: Online-Aufgaben und Projektarbeit
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	Bitte entnehmen Sie die Termine dem aktuellen Semesterkatalog
Gebühr	900,00 Euro

Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements Risiko und Sustainability Alternativer Investments

Wahlpflichtmodul

Lehrende*r	Dr. 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 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 im ersten Teil die wesentlichen Merkmale, Chancen und Risiken von Alternativen Investments als Anlageklasse insbesondere in Abgrenzung zu traditionellen Investments. Danach beschäftigen sich die Teilnehmer 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 Präsenzworkshops
Teilnehmerzahl	max. 22 Teilnehmende
Voraussetzungen	Keine
Verwendbar. d. Moduls	Wahlpflichtmodul
Voraus. f. 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.zwei 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	Bitte entnehmen Sie die Termine dem aktuellen Semesterkatalog
Gebühr	900,00 Euro

Masterabschlussmodul

Pflichtmodul

Lehrende*r	Dr. Jörg Best
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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Internetgestütztes Online-Kolloquium mit Mentorieller Betreuung, 2. Individuelle Betreuung durch eine*n Gutachter*in des Masterstudiengangs, 3. Abschließendes Kolloquium zur Vorstellung der Masterarbeit mit anschließender Diskussion. <p>Im Laufe des Online-Kolloquiums erstellen die Studierenden ein Exposé der geplanten Themenstellung ihrer Masterarbeit. Die Online-Intensivphasen (internetgestützte Diskussionsphasen) im Rahmen des Online-Kolloquiums (ca. 10 Tage) dienen der Vorstellung, Diskussion und Überarbeitung des Exposés der Teilnehmenden. Teilnehmende und Mentor*in geben dazu Feedback.</p> <p>In der Vorbereitung der Kompaktwochen werden die Studierenden durch eine*n Mentor*in unterstützt. Die Mentor*in bzw. der Mentor steht auch während und zwischen den Online-Intensivphasen für die Klärung organisatorischer und formaler Fragen zur Verfügung. Fachliche Fragen beantworten parallel die Gutachter*innen.</p> <p>Die Selbststudienmaterialien beinhalten: Themensuche (Arten wissenschaftlicher Abschlussarbeiten, Strategien zur Themenfindung, Festlegung des Themenbereichs), Materialsuche (Literatur beschaffen, Literaturlauswertung, Literaturverwaltung), das Thema erarbeiten (Fragestellung, Zielsetzung, Exposé), Aufbau und Gliederung (Grundlagen, formale Anforderungen, Aufbau), Dokumentation der Quellen.</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. 12 Teilnehmende
Voraussetzungen	Keine; für den Zulassungsantrag zur Masterarbeit: Prüfungsleistungen im Umfang von mindestens 48 KP
Verwendbarkeit des Moduls	Pflichtmodul, dieses Modul flankiert die Erstellung der Masterarbeit.
Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten	<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
Kreditpunkte und Noten	Kreditpunkte: 24 KP (Online-Kolloquium 2 KP; Masterarbeit 20 KP, Abschlusskolloquium 2KP) 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 Master-Modul wird in jedem Semester angeboten.
Arbeitsaufwand	Gesamt: ca. 720 Std.
Dauer	/
Termine	Bitte entnehmen Sie die Termine dem aktuellen Semesterkatalog
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/risikomanagement

