Modulhandbuch

Risikomanagement für Finanzdienstleister - Master-Studiengang

im Sommersemester 2020

erstellt am 29.03.2024

rmf110 - Quantitative Methoden 4
rmf120 - Regulierung von Finanzdienstleistern 6
rmf140 - Monte Carlo Methoden 8
rmf150 - Quantitatives Risikomanagement 9
rmf160 - Portfolio- und Kapitalmarkttheorie 11
rmf170 - Unternehmensbewertung 12
rmf180 - Finanzinstrumente 13
rmf300 - R - Software und Tools für Financial Data Analytics 14
rmf370 - Unternehmensbewertung und Unternehmensfinanzierung 16
rmf360 - Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie 18
rmf510 - Risikomodelle - Risiken in der Versicherung 20
rmf520 - Ausfallrisiko und Rating 21
rmf530 - Informationsmanagement 23
rmf540 - Asset Liability Management 25
rmf550 - Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements 1 26
rmf560 - Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements 2 27
rmf130 - Finanzintermediation 28
rmf190 - Accounting und Corporate Governance 30
rmf200 - Qualitatives Risikomanagement und Behavioural Finance 31
rmf210 - Extremwert- und Operationelle Risiken 33
rmf220 - Risikokommunikation 35

rmf570 - Financial Data Analytics mit R: Methoden und Anwendungen 37
rmf130 - Finanzintermediation 39

Pflichtmodule

rmf110 - Quantitative Methoden

Modulbezeichnung	Quantitative Methoden
Modulkürzel	rmf110
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 170 Std; synchrone Phasen: ca. 10 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Pflichtmodule
Zuständige Personen	• Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	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.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von zwei Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, Web-Seminare, Online-Workshop
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistung	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und synchronen Phasen • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf120 - Regulierung von Finanzdienstleistern

Modulbezeichnung	Regulierung von Finanzdienstleistern
Modulkürzel	rmf120
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Janßen, Stefan (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Jörg Prokop
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	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.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von zwei Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation), Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	

Angebotsrhythmus	--

rmf140 - Monte Carlo Methoden

Modulbezeichnung	Monte Carlo Methoden
Modulkürzel	rmf140
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; Präsenzphasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Pfeifer, Dietmar (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	Die Studierenden sind in der Lage, selbständig simulative Risikostudien zu erstellen und Ergebnisse solcher Rechnungen mit Expertinnen und Experten auf Augenhöhe zu diskutieren sowie gegebenenfalls auch kritisch zu hinterfragen.
Modulinhalte	Algorithmen für Standard-Zufallszahlen, Erzeugung von Zufallszahlen mit vorgegebener Verteilung (Inversionsmethode, Verwerfungsmethode, Kompositionsmethode), Erzeugung von Zufallsvektoren mit mehrdimensionaler Struktur (multivariate Normalverteilung, Copulas), interne Unternehmensmodelle.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung oder Klausur

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf150 - Quantitatives Risikomanagement

Modulbezeichnung	Quantitatives Risikomanagement
Modulkürzel	rmf150
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 155 Std; synchrone Phasen: ca. 25 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Dubischar, Daniel Clemens (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Angelika May
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	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
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops und Web-Seminare
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen, Präsenzworkshops und Web-Seminaren • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online Aufgaben und Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*

SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf160 - Portfolio- und Kapitalmarkttheorie

Modulbezeichnung	Portfolio- und Kapitalmarkttheorie
Modulkürzel	rmf160
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Prokop, Jörg (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	Die Teilnehmenden 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.
Modulinhalte	Gegenstand der Veranstaltung ist die Theorie des Wertpapiermanagements. - Nach welchen Kriterien sollten rationale Akteure am Kapitalmarkt ihre Anlageentscheidungen unter Unsicherheit treffen? - Was determiniert den Preis der am Kapitalmarkt gehandelten Finanzinstrumente? - Welche Auswirkungen haben unterschiedliche Risikopräferenzen und Anlagehorizonte auf die Anlageentscheidung? 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.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	• Regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Kurzprüfung oder Kurzklausur

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf170 - Unternehmensbewertung

Modulbezeichnung	Unternehmensbewertung
Modulkürzel	rmf170
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Prokop, Jörg (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	Die Studierenden kennen die theoretischen Grundlagen, Möglichkeiten und Grenzen gängiger Unternehmensbewertungsmethoden. Sie sind in der Lage, die Auswirkungen von im Rahmen der Bewertung getroffenen Modellierungsentscheidungen auf das Bewertungsergebnis einzuschätzen und deren Plausibilität kritisch zu hinterfragen.
Modulinhalte	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 Kapitalmartkmodellen. Darüber hinaus werden Fragen der Informationsverarbeitung am Kapitalmarkt behandelt.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • Regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzreferat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation) oder Kurzklausur

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf180 - Finanzinstrumente

Modulbezeichnung	Finanzinstrumente
Modulkürzel	rmf180
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Pflichtmodule
Zuständige Personen	• Varmaz, Armin (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Jörg Prokop
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	Die Studierenden können verschiedene Instrumente der Unternehmensfinanzierung und des finanzwirtschaftlichen Risikomanagements unterscheiden und hinsichtlich ihrer Vor- und Nachteile kritisch beurteilen.
Modulinhalte	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.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshos • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Thesenpapie

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf300 - R - Software und Tools für Financial Data Analytics

Modulbezeichnung	R - Software und Tools für Financial Data Analytics
Modulkürzel	rmf300
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Pflichtmodule
Zuständige Personen	• Reh, Lena (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	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 im Modul „Quantitative Methoden“): 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. Machine Learning mit R: K-Nearest Neighbors, Decision Trees und Random Forests, sowie Neural Networks. 8. Etwas Programmierung: Kontrollstrukturen, eigene Funktionen in R, For-Schleifen und deren Vermeidung; eigene Datenstrukturen (S3-Methoden), Integration von kompiliertem Code 9. Nachhaltige Software: Erstellung von R-Manuals mit Roxygen, Speichern von Analysen in (Jupyter) Notebooks, Vignetten, Einsatz von Versionierungstools/git 10. Anbindung nach „außen“: Interfaces zu Datenbanken, R und Parallelisierung / auf dem Cluster

Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von zwei Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, Präsenzworkshop und Web-Seminare
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen, Präsenzworkshop und Web-Seminaren • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Projektarbeit (längere Programmieraufgabe in Gruppen)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf370 - Unternehmensbewertung und Unternehmensfinanzierung

Modulbezeichnung	Unternehmensbewertung und Unternehmensfinanzierung
Modulkürzel	rmf370
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Prokop, Jörg (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	Im Mittelpunkt des Moduls stehen theoretische Grundlagen sowie empirische Aspekte des Portfoliomanagements und des Asset Pricing. Insbesondere werden folgende Fragen behandelt: • 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?
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(*

	**Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.))*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf360 - Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie

Modulbezeichnung	Finanzmärkte und Finanzmarkttheorie
Modulkürzel	rmf360
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Pflichtmodule
Zuständige Personen	• Prokop, Jörg (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	Im Mittelpunkt des Moduls stehen theoretische Grundlagen sowie empirische Aspekte des Portfoliomanagements und des Asset Pricing. Insbesondere werden folgende Fragen behandelt: • 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?
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(*

	**Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.))*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

Wahlpflichtmodule

rmf510 - Risikomodelle - Risiken in der Versicherung

Modulbezeichnung	Risikomodelle - Risiken in der Versicherung
Modulkürzel	rmf510
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Christiansen, Marcus (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	Die Studierenden verstehen die stochastischen Grundlagen der Personen-, Sach-, Rückversicherungsmathematik und der Finanzmathematik und können aktuarielle Berechnungen von Experten dazu dem Grunde nach nachvollziehen.
Modulinhalte	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, Prämiendifferenzierung und Spätschadenreserven in der Sachversicherung, Formen und Zielsetzungen der Risikoteilung (proportionale und nicht-proportionale Rückversicherung).
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung oder Klausur

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf520 - Ausfallrisiko und Rating

Modulbezeichnung	Ausfallrisiko und Rating
Modulkürzel	rmf520
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Nzouankeu Nana, Giles-Arnaud (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Peter Ruckdeschel
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	• Die Teilnehmenden können Ausfallrisiken und Kreditrisiken von Finanzinstrumenten bzw. Kontraktpartner*innen 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.
Modulinhalte	**Aktuelle Modulvertiefung: Auswirkungen der COVID-Krise auf die Modellierung, Messung und Steuerung des Kreditrisikos** 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. 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 (u.a. von der EBA, EZB und Bundesregierung) für die Behandlung der COVID betroffenen Bankkund*innen und ihre aktuellen Einflüsse auf die Messung und den Risikovorsorgeprozess als auch die zukünftigen Auswirkungen auf die Modellierung von Ratingsystemen (auf die Antrags-Scorekarten und auf die Verhaltens-Scorekarten) untersucht. Zusätzlich werden auch statistische Modelle zur Schätzung der COVID-Effekte vorgestellt und diskutiert.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Online-Workshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Online-Workshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Thesenpapier

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf530 - Informationsmanagement

Modulbezeichnung	Informationsmanagement
Modulkürzel	rmf530
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Lüssem, Jens (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Angelika May
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	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
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	

Angebotsrhythmus	--

rmf540 - Asset Liability Management

Modulbezeichnung	Asset Liability Management
Modulkürzel	rmf540
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Schlütter, Sebastian (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Angelika May
Teilnahmevoraussetzungen	Quantitative Methoden
Kompetenzziele	• Die Studierenden lernen die Prinzipien eines gleichzeitigen Monitorings von versicherungs-technischen 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 (z.B. Duration) berechnen und interpretieren.
Modulinhalte	Kapitalmarktmodelle, deterministische und stochastische Modelle für die Passivseite, Risikomaße, Risikoklassen, Sicherheitskapital, Testszenarien, Projektionsrechnung, Stresstests, wertorientierte Unternehmenssteuerung
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Fallstudie und mündliche Prüfung oder Klausur

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf550 - Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements 1

Modulbezeichnung	Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements 1
Modulkürzel	rmf550
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Wechselnde Lehrende (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Angelika May
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	Je nach gewähltem Thema
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. zwei Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, i.d.R. zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: je nach gewähltem Thema

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf560 - Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements 2

Modulbezeichnung	Ausgewählte Aspekte des Risikomanagements 2
Modulkürzel	rmf560
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Wechselnde Lehrende (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Angelika May
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	Je nach gewähltem Thema
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. zwei Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, i.d.R. zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: je nach gewähltem Thema

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf130 - Finanzintermediation

Modulbezeichnung	Finanzintermediation
Modulkürzel	rmf130
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Prokop, Jörg (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• Die Teilnehmenden kennen verschiedene Theorien zur Erklärung des Verhaltens ökonomischer Akteure und können sie voneinander abgrenzen. • Sie können die Existenz von Banken, Versicherungen und anderen Finanzintermediären am Kapitalmarkt anhand informations- und institutionenökonomischer Argumente begründen. • 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 nationalen und internationalen Finanzmarktstrukturen vertraut und können Teilbereiche des Finanzmarkts voneinander abgrenzen.
Modulinhalte	Im Mittelpunkt der Veranstaltung steht die Vermittlung der institutionellen Grundlagen des Finanzsektors. Behandelt wird zum einen die Struktur der internationalen und der nationalen Finanzmärkte. Zum anderen wird auf Basis ökonomischer Theorien untersucht, welche Funktionen Finanzintermediäre – insbesondere Kreditinstitute und Versicherungsunternehmen – auf Geld- und Kapitalmärkten übernehmen, welche Leistungen sie erbringen, welchen Anreizkonflikten sie ausgesetzt sind und welche einzel- und gesamtwirtschaftlichen Risiken mit ihren Aktivitäten verbunden sind. Ausgewählte Aspekte des Themas werden von den Studierenden im Rahmen des internetgestützten Selbststudiums allein oder in Kleingruppen eigenständig erarbeitet und können in der zweiten Präsenzphase präsentiert werden.
Literaturempfehlungen	
Links	
Unterrichtsprachen	
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	unbegrenzt (22)
Hinweise	Pflichtmodul
Modulart	Pflicht / Mandatory
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul		• Regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzphasen • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Kurzreferat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar
Angebotsrhythmus	

rmf190 - Accounting und Corporate Governance

Modulbezeichnung	Accounting und Corporate Governance
Modulkürzel	rmf190
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Meier, Jan-Hendrik (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	Die Studierenden kennen die zentralen Begriffe und Problembereiche der Corporate Governance und können das erworbene Wissen auf praktische Problemstellungen anwenden.
Modulinhalte	• Einführung • Theoretische Grundlagen • Corporate Governance Mechanismen • Corporate Governance und externe Rechnungslegung • Corporate Governance und Kontrolle
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf200 - Qualitatives Risikomanagement und Behavioural Finance

Modulbezeichnung	Qualitatives Risikomanagement und Behavioural Finance
Modulkürzel	rmf200
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Lohmann, Karl (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Jörg Prokop
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	Aufbauend auf den Inhalten des Moduls „Regulierung von Finanzdienstleistern“ behandelt Teil I 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. Teil II 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.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
		• Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf210 - Extremwert- und Operationelle Risiken

Modulbezeichnung	Extremwert- und Operationelle Risiken
Modulkürzel	rmf210
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 155 Std; synchrone Phasen: ca. 25 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Dubischar, Daniel Clemens (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Marcus Christiansen
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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 zum Beispiel bei Naturgefahren im Versicherungs-bereich 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.
Modulinhalte	Extremwertverteilungen und ihre Herleitung (Fréchet-, Gumbel- und Weibullverteilung), statistische Verfahren zur Schätzung des Tail-Index, Hill-Plots, Schadenmodelle am Beispiel geophysikalischer 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).
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops und Web-Seminare
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen, Präsenzworkshops und Web-Seminaren • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und mündliche Prüfung oder Klausur

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf220 - Risikokommunikation

Modulbezeichnung	Risikokommunikation
Modulkürzel	rmf220
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Blomenkamp, Andreas (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Weitere verantwortliche Personen	Prof. Dr. Angelika May
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	• Allgemeine Kommunikationstheorie • Besonderheiten der Risikokommiunikation • Interne und externe Risikokommunikation • Krisenkommunikation • Reflexion des eigenen Kommunikationsverhaltens
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online Aufgaben und Referat (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)*

	)
SWS	
Angebotsrhythmus	--

rmf570 - Financial Data Analytics mit R: Methoden und Anwendungen

Modulbezeichnung	Financial Data Analytics mit R: Methoden und Anwendungen
Modulkürzel	rmf570
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	• Master Risikomanagement und Finanzanalyse (Master) > Wahlpflichtmodule
Zuständige Personen	• Ruckdeschel, Peter (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• Die Teilnehmenden sammeln praktische Erfahrung im Umgang mit statistischen Datenanalysen im Versicherungs- und 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.
Modulinhalte	Allgemein: • multivariate Verfahren: Hauptkomponentenanalyse / Dimensionsreduktion, Diskriminanzanalyse & Klassifikation, Clustering, Multidimensional Scaling • Techniken des maschinellen Lernens: Modellwahl und Regularisierung (Lasso, elasticnet, Kreuzvalidierung), Bagging Boosting. Klassifikationsbäume, Random Forest, Einstieg in TensorFlow, Einstieg in Text Mining • Zeitreihen und prädiktive Modelle R für Finanzdienstleister: • R verbinden mit anderer IT-Infrastruktur (R & Excel, R & Datenbanken, das R Bloomberg-package.) • Infrastruktur für R in Versicherungs- und Finanzanwendungen (Verarbeitung von Zeitangaben, Rmetrics; R-Pakete für die Versicherung; Pakete zur Portfolio Optimierung; domänenspezifische Dateninfrastruktur) Drei weitere Kapitel richten sich an den Schwerpunkten der Hörerschaft aus und werden ausgewählt aus: • Parametrische Volatilitätsmodellierung in R • Zinsmodelle / Fixed Income • Prädiktive Modelle in der Tarifierung • Unsicherheitsbemessung und Exposureberechnung in der Schadenreservierung Langlebigkeitsrisiko und Sterbetafeln • Berechnung von Value at Risk und Expected Shortfall in R • Copulas in R • Kreditrisiko in R
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	16 Wochen Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25

Modulart	Wahlpflicht / Elective	
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)	
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops	
Vorkenntnisse	./.	
Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Online-Aufgaben und Projektarbeit
Lehrveranstaltungsform	Seminar *(* **Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.)* *)*	
SWS		
Angebotsrhythmus	--	

rmf130 - Finanzintermediation

Modulbezeichnung	Finanzintermediation
Modulkürzel	rmf130
Kreditpunkte	6.0 KP
Workload	180 h (internetgestützte (betreute) Selbstudienphasen: ca. 160 Std; synchrone Phasen: ca. 20 Std.)
Verwendbarkeit des Moduls	
Zuständige Personen	• Prokop, Jörg (Modulverantwortung) • Center für lebenslanges Lernen (C3L) (Modulverantwortung)
Teilnahmevoraussetzungen	Keine
Kompetenzziele	• 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.
Modulinhalte	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.
Literaturempfehlungen	./.
Links	./.
Unterrichtssprache	Deutsch
Dauer in Semestern	1 Semester
Angebotsrhythmus Modul	Das Modul wird in einem Turnus von ca. vier Semestern angeboten.
Aufnahmekapazität Modul	25
Modulart	Wahlpflicht / Elective
Modullevel	MM (Mastermodul / Master module)
Lehr-/Lernform	Internetgestütztes Studium (Einzeln und in Gruppen), Bearbeitung von Übungsaufgaben, zwei Präsenzworkshops
Vorkenntnisse	./.

Prüfung	Prüfungszeiten	Prüfungsform
Gesamtmodul	Studienbegleitende Prüfungsleistungen	Voraussetzung für Vergabe von Kreditpunkten: • regelmäßige Teilnahme an Online-Diskussionen und Präsenzworkshops • Bestehen der studienbegleitenden Prüfungsleistungen: Projektarbeit (schriftliche Ausarbeitung und Präsentation)

Lehrveranstaltungsform	Seminar *(*

	**Die Angaben zu den folgenden Punkten ergeben sich aus der Modulbeschreibung (s.o.))*
SWS	
Angebotsrhythmus	--