

Modulhandbuch

DAS Zertifikatsstudium

Financial Risk Management

Hochschule Koblenz

Fachbereich Wirtschafts- und Sozialwissenschaften



Inhalt

| | |
|---|----------|
| Studienkonzept | 3 |
| Das Wichtigste in Kürze | 3 |
| Studienverlaufsplan | 4 |
| Prüfungsplan | 4 |
| Financial Risk Management (FRM) | 5 |
| <i>FRM 11 Quantitative Methoden</i> | 5 |
| <i>FRM 31 Management von Financial Risks und Modellierung</i> | 7 |
| <i>FRM 32 Corporate Governance und Risikomanagement</i> | 10 |
| <i>FRM 21 Portfoliotheorie</i> | 13 |
| <i>FRM 41 Enterprise Risk Management</i> | 15 |
| <i>FRM 42 Regulierung von Finanzdienstleistungen</i> | 20 |

Studienkonzept

Der berufsbegleitend konzipierte, zweisemestrige DAS-Zertifikatsfernstudiengang wird im Rahmen des akkreditierten MBA-Fernstudienprogramms an der Hochschule Koblenz angeboten und umfasst die Vertiefungsrichtungsmodulare des MBA-Fernstudiengangs. Er ist konzipiert für und ausgerichtet an den Bedarfen der berufstätigen Studierenden und ermöglicht den Erwerb von Führungskompetenzen sowie die Professionalisierung in der gewählten Fachrichtung.

Die Studieninhalte werden auf Basis neuester wissenschaftlicher Erkenntnisse und mit hohem Praxisbezug von erfahrenen Hochschullehrenden vermittelt. Die gewonnenen Kenntnisse können durch das berufsbegleitende Konzept unmittelbar in den beruflichen Alltag einfließen. Dies ermöglicht einen direkten Theorie-Praxis-Transfer.

Das DAS-Zertifikatsstudium eignet sich somit speziell für Fach- und Führungskräfte die gehobene sowie höhere Managementaufgaben wahrnehmen möchten.

Das modularisierte Weiterbildungskonzept basiert auf einer Mischung aus Selbststudium (unterstützt durch Studienbriefe und Online-Lernkomponenten) und vier bis fünf Online- und Präsenzveranstaltungstagen je Semester. Die Teilnahme an den jeweils samstags stattfindenden Veranstaltungsangeboten ist grundsätzlich freiwillig, wird jedoch für einen optimalen Studienerfolg dringend empfohlen. Die studienbegleitenden Klausuren finden vor Ort in Remagen statt.

Das Wichtigste in Kürze

Anbieter:

Hochschule Koblenz, RheinAhrCampus Remagen,
Fachbereich Wirtschafts- und Sozialwissenschaften

Studiengangleitung:

Herr Prof. Dr. Uwe Hansen

Herr Prof. Dr. Thomas Mühlencoert

Studiengang bzw. Abschlussart:

Diploma of Advanced Studies Financial Risk Management (DAS FRM)

Studienform:

Berufsbegleitend konzipiertes, zweisemestriges Zertifikatsstudium

Studiendauer und ECTS-Zahl:

2 Semester, 32 Credit Points

Studienverlaufsplan

| Studienverlaufsplan | | | | | |
|--|---|----|--|---------|---------------------------------------|
| Regelsemester, Prüfungsleistungen, Studienleistungen, Gewichtungen | | | | | |
| Studienbeginn WS/SS | | | | | |
| Modul-code | Modulbezeichnung | CP | Regelsemester der Prüfungsleistungen (PL) / Studienleistungen (SL) | | Gewichtung zur Bildung der Gesamtnote |
| | | | 1. Sem. | 2. Sem. | |
| Pflichtmodule | | | | | |
| FRM 11 | Quantitative Methoden | 5 | PL | | 5/32 |
| FRM 31 | Management von Financial Risks und Modellierung | 6 | PL | | 6/32 |
| FRM 32 | Corporate Governance und Risikomanagement | 5 | PL | | 5/32 |
| FRM 21 | Portfoliotheorie | 5 | | PL | 5/32 |
| FRM 41 | Enterprise Risk Management | 6 | | PL | 6/32 |
| FRM 42 | Regulierung von Finanzdienstleistungen | 5 | | PL | 5/32 |

Erklärungen/Legende:

CP = Credit-Points

PL = Prüfungsleistung nach § 7 Abs.2

SL = Studienleistung nach § 7 Abs. 3

Prüfungsplan

| Modul-Nr. | Modulbezeichnung | Gegenstand der Prüfung/Kompetenzbereich | Credit Points | zu erbringende Leistung | Art der Leistung | Prüfungsdauer [min.] | Gewichtung in der Gesamtnote |
|---------------------|---|---|---------------|-------------------------|------------------|----------------------|------------------------------|
| 1. Semester: | | | | | | | |
| FRM 11 | Quantitative Methoden | Fachwissen, Methoden- & Führungskompetenz | 5 | PL | K | 60 | 5/32 |
| FRM 31 | Management von Financial Risks und Modellierung | Fachwissen, Methoden- & Führungskompetenz | 6 | PL | K | 120 | 6/32 |
| FRM 32 | Corporate Governance und Risikomanagement | Fachwissen, Methoden- & Führungskompetenz | 5 | PL | K | 60 | 5/32 |
| 2. Semester: | | | | | | | |
| FRM 21 | Portfoliotheorie | Fachwissen, Methoden- & Führungskompetenz | 5 | PL | K | 60 | 5/32 |
| FRM 41 | Enterprise Risk Management | Fachwissen, Methoden- & Führungskompetenz | 6 | PL | K | 120 | 6/32 |
| FRM 42 | Regulierung von Finanzdienstleistungen | Fachwissen, Methoden- & Führungskompetenz | 5 | PL | HA | | 6/32 |

Erklärungen/Legende:

PL = Prüfungsleistung

K = Klausur

HA = Hausaufgabe

| Financial Risk Management (FRM) | | | | |
|--|---|----------------------|------------------------------|--|
| FRM 11 Quantitative Methoden | | | | |
| Modulnummer | Workload | Credits | Zertifikatssemester | Dauer |
| FRM 11 | 150 h | 5 | 1. Sem. | 1 Semester |
| | Kontaktzeit | Selbststudium | Geplante Gruppengröße | Häufigkeit des Angebots |
| | 8 h | 142 h | je 4 - 20 Studierende | Jedes Semester (1 Lehrveranstaltung pro Semester) |
| 1 | Lehrveranstaltung des 1. Zertifikatssemesters | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Quantitative Methoden | | | |
| 2 | Lernziele | | | |
| | <p>Nach dem Studium dieses Moduls können die Studierenden</p> <ul style="list-style-type: none"> • das statistische Vokabular zur Beschreibung von Daten kennen und tabellarische Darstellungen von Daten erstellen und interpretieren, • wesentliche Kennzahlen zu Lage, Streuung und Korrelation quantitativer Daten ermitteln und bewerten, • verschiedene Diagrammtypen zur Darstellung qualitativer und quantitativer Daten kennen, zielführend einsetzen und interpretieren, • totale und bedingte Wahrscheinlichkeiten von Ereignissen, Verteilungsfunktionen von Zufallsvariablen sowie deren Erwartungswert und Varianz in einem wahrscheinlichkeitstheoretischen Modell ermitteln, • eine Punkt- und Intervallschätzung für eine gesuchte Kenngröße eines Datenbestandes vornehmen, • Ein- und Zweistichproben tests für Mittelwerte und Erfolgswahrscheinlichkeiten problemspezifisch auswählen, durchführen und auswerten, • geeignete Verfahren zur Messung des Ausreißerrisikos und der Konzentration in einem Datenbestand kennen und anwenden. | | | |
| | Kompetenzen | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Sach- und Methodenkompetenz • Analytisches Denkvermögen • Wirtschaftliches Denken und Handeln • Fähigkeit zur Komplexitätsreduktion und zur Entwicklung von Ursache-Wirkungs-Beziehungen • Erarbeitung von Handlungsalternativen und deren Evaluation in Problemsituationen • Fähigkeit zum Theorie-Praxis-Transfer • Entwicklung von Führungskompetenzen • Fähigkeit zur Anfertigung wissenschaftlicher Arbeiten | | | |

| | |
|-----------|---|
| 3 | <p>Inhalte</p> <p>Die Erfassung, Messung und Bewertung unternehmerischer Risiken stellt eine Kernaufgabe des Financial Risk Management dar. Grundkenntnisse in quantitativen Methoden, insbesondere in den Verfahren der beschreibenden und schließenden Statistik, sind daher für jeden Risikomanager unverzichtbar. In diesem Modul werden diese grundlegenden Verfahren behandelt.</p> <p>Dazu werden Kennzahlen-basierte und graphische Verfahren der beschreibenden Statistik zur Darstellung, Zusammenfassung und Analyse von Daten bereitgestellt. Für die schließende Statistik werden zunächst die Grundlagen aus der Wahrscheinlichkeitstheorie erarbeitet. Anschließend werden die wesentlichen Konzepte der Schätztheorie und des statistischen Testens entwickelt.</p> <p>Abschließend gibt die Lehreinheit eine Einführung in fortgeschrittene Analyseverfahren zur Untersuchung des Konzentrationsrisikos sowie des Risikos von Ausreißern in einem Datenbestand.</p> |
| 4 | <p>Lehrformen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Selbstständige Bearbeitung der Studienbriefe, Literaturstudium • Fragend-entwickelnder Unterricht • Zahlreiche Rechen- und Übungsbeispiele • Praxisbezogene Fallstudien • Online-Betreuung, diverse E-Learning-Angebote |
| 5 | <p>Teilnahmevoraussetzungen</p> <p>Formal: Zulassung zum Zertifikatsstudium Inhaltlich (zur Vorbereitung der Präsenzveranstaltung): Kenntnis des Studienbriefs</p> |
| 6 | <p>Prüfungsleistung (Art, Umfang)</p> <p>Klausur (60 Minuten)</p> |
| 7 | <p>Zugelassene Hilfsmittel in Klausuren</p> <p>Nicht-programmierbarer Taschenrechner entsprechend den Richtlinien des Fachbereiches</p> |
| 8 | <p>Voraussetzungen für die Vergabe von Kreditpunkten</p> <p>Bestehen der Prüfungsleistung (mindestens 50% der Gesamtpunktzahl).</p> |
| 9 | <p>Stellenwert der Note für die Endnote</p> <p>Gewichtung: 5/90</p> |
| 10 | <p>Modulverantwortlicher/Lehrender</p> <p>Prof. Dr. Claus Neidhardt</p> |
| 11 | <p>Studienbriefe/sonstige Literatur</p> <ul style="list-style-type: none"> • Quantitative Methoden; Neidhardt; 1. Aufl. 2016 • Zusätzlich online-verfügbares Lernmaterial • Siehe Angaben in den Studienbriefen |
| 12 | <p>Sonstige Informationen ./.</p> |
| 13 | <p>Verwendung des Moduls (in anderen Studiengängen) ./.</p> |

| FRM 31 Management von Financial Risks und Modellierung | | | | |
|--|---|---------------|-----------------------|--|
| Modulnummer | Workload | Credits | Zertifikatssemester | Dauer |
| FRM 31 | 180 h | 6 | 1. Sem. | 1 Semester |
| | Kontaktzeit | Selbststudium | Geplante Gruppengröße | Häufigkeit des Angebots |
| | 16 h | 164 h | je 4 - 20 Studierende | Jedes Semester (2 Lehrveranstaltungen pro Semester) |
| 1 | Lehrveranstaltungen des 1. Zertifikatssemesters | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Management von Financial Risks • Modellierung | | | |
| 2 | Lernziele | | | |
| | <p>Nach dem Studium der Lehreinheit <i>Management von Financial Risks</i> können die Studierenden</p> <ul style="list-style-type: none"> • wichtige Finanzmarktprodukte bewerten, in ihrer Wirkungsweise beurteilen, ihre Risiken einschätzen und quantifizieren; • eigenständig Strategien für die Absicherung von Marktrisiken entwickeln und auf konkrete Sachverhalte und Portfolien anwenden; • wichtige Einflussgrößen auf Kreditrisiken frühzeitig identifizieren, quantifizieren und Strategien zur Reduktion entwickeln; • wesentliche Konzepte des Liquiditätsrisiko-Managements sowie des Managements nichtfinanzieller Risiken auf konkrete Fragestellungen im unternehmerischen Kontext anwenden und hierbei branchenspezifischen Besonderheiten Rechnung tragen. <p>Nach dem Studium der Lehreinheit <i>Modellierung</i> können die Studierenden</p> <ul style="list-style-type: none"> • den Nutzen mathematischer Modelle im Risikomanagement darlegen, • kontinuierliche Modelle an Beobachtungen anpassen, • einfache binäre Klassifikationsprobleme mit Hilfe der logistischen Regression lösen, • die Unsicherheit von Modellparametern quantifizieren, • Grenzen der Modelle erläutern. <p>Kompetenzen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Sach- und Methodenkompetenz • Analytisches Denkvermögen • Wirtschaftliches Denken und Handeln • Fähigkeit zur Komplexitätsreduktion und zur Entwicklung von • Ursache-Wirkungs-Beziehungen • Erarbeitung von Handlungsalternativen und deren Evaluation in Problemsituationen • Fähigkeit zum Theorie-Praxis-Transfer • Entwicklung von Führungskompetenzen • Fähigkeit zur Anfertigung wissenschaftlicher Arbeiten | | | |

3 **Inhalte***Management von Financial Risks*

Der Finanzdienstleistungssektor spielt eine wesentliche Rolle für das unternehmerische Risikomanagement. Er bietet Unternehmen umfangreiche Produkte zur aktiven Steuerung finanzieller Risiken. So können Währungskurs-, Preisänderungs- und Zinsänderungsrisiken über entsprechende Derivate abgesichert werden. Kapitalmärkte dienen ebenso der Beschaffung von Liquidität.

In der Kurseinheit „Management von Financial Risks und ausgewählten Non-Financial Risks“ wird daher ein Überblick über die Geld- und Kapitalmärkte und ihre verschiedenen Segmente, über regulatorische Rahmenbedingungen sowie über verschiedene relevante Produkte gegeben. Aufgrund der hohen Bedeutung, die zinstragende Instrumente und damit verbundene Zinsänderungsrisiken innerhalb und außerhalb der Finanzwelt haben, wird in der Kurseinheit „Management von Financial Risks und ausgewählten Non-Financial Risks“ besonderer Wert auf Anleihen und Zinsderivate gelegt. Die Bewertung ausgewählter Finanzinstrumente ebenso wie ihr Einsatz bei einem aktiven Risikomanagement, in dem Risiken nicht nur gemessen, sondern aktiv gesteuert und abgesichert werden, ist einer der Schwerpunkte.

Einen weiteren Schwerpunkt bildet die Messung, Modellierung und Steuerung von Kreditrisiken auf Einzelkredit- sowie auf Portfolioebene.

Auch auf Möglichkeiten der Liquiditätsrisikosteuerung und der Steuerung operationeller Risiken wird in dieser Kurseinheit eingegangen. Dabei werden Unterschiede zwischen dem Liquiditätsrisiko einer Versicherung im Gegensatz zu dem einer Bank herausgearbeitet und einige Steuerungskonzepte vorgestellt.

Die diskutierten Sachverhalte und Fragestellungen werden durch umfangreiche Fallstudien, Beispiele und Übungen begleitet.

Modellierung

Die quantitative Bewertung von Risiken basiert auf Modellen, die sich wiederum auf vereinfachende Annahmen stützen und oft unbekannte – zu schätzende – Parameter enthalten. In der Kurseinheit werden zunächst Beispiele solcher Modelle besprochen und nach verschiedenen Kriterien klassifiziert.

Am Beispiel von Marktrisiken werden stochastische Modelle entwickelt. Vereinfachende Annahmen, z.B. über die Verteilung und stochastische Unabhängigkeit von Ereignissen werden kritisch diskutiert und zur Verbesserung der Modelle modifiziert.

Methoden zur Schätzung von Modellparametern werden am Beispiel der linearen Regression besprochen und zu komplexeren Methoden wie etwa der logistischen Regression zur Schätzung der Ausfallwahrscheinlichkeiten von Krediten verallgemeinert. Der verantwortungsvolle Umgang mit den Modellen setzt voraus, dass man sich der Grenzen der Modelle ebenso bewusst ist wie der Tatsache, dass die Modellparameter nur geschätzt, nicht aber exakt bestimmt sind. Mit Hilfe statistischer Verfahren wie dem Bootstrapping wird gezeigt, wie man sich einen Überblick über die Schätzrisiken verschafft. Schließlich wird dargestellt, wie Modelle in computergestützten Simulationsverfahren verwendet werden, um quantitative Fragen des Risikomanagements, z.B. zur Bestimmung des Value at Risk zu beantworten.

| | |
|-----------|--|
| 4 | Lehrformen <ul style="list-style-type: none"> • Selbstständige Bearbeitung der Studienbriefe, Literaturstudium • Fragend-entwickelnder Unterricht • Zahlreiche Rechen- und Übungsbeispiele • Praxisbezogene Fallstudien • Online-Betreuung, diverse E-Learning-Angebote |
| 5 | Teilnahmevoraussetzungen Formal: Zulassung zum Zertifikatsstudium Inhaltlich (zur Vorbereitung der Präsenzveranstaltung): <ul style="list-style-type: none"> • Kenntnis der Studienbriefe <i>Management von Financial Risks</i> <ul style="list-style-type: none"> • Kenntnis der Studienbriefe „Portfoliotheorie, Marktrisiken und die Bewertung von Derivaten“ und „Quantitative Methoden“ <i>Modellierung</i> <ul style="list-style-type: none"> • Kenntnis der Studienbriefe „Quantitative Methoden“, „Portfoliotheorie, Marktrisiken und die Bewertung von Derivaten“ |
| 6 | Prüfungsleistung (Art, Umfang) Klausur (120 Minuten) |
| 7 | Zugelassene Hilfsmittel in Klausuren Taschenrechner entsprechend den Richtlinien des Fachbereiches |
| 8 | Voraussetzungen für die Vergabe von Kreditpunkten Bestehen der Prüfungsleistung (mindestens 50% der Gesamtpunktzahl der Modulklausur). |
| 9 | Stellenwert der Note für die Endnote Gewichtung: 6/90 |
| 10 | Modulverantwortliche Prof. Dr. Martina Brück Lehrende Prof. Dr. Martina Brück Prof. Dr. Uwe Jaekel |
| 11 | Studienbriefe/sonstige Literatur <ul style="list-style-type: none"> • Management von Financial Risks und ausgewählten Non-Financial Risks; Brück, Apwisch; 2. Aufl. 2021. • Modellierung; Jaekel; 1. Auflage 2017. • Zusätzlich online-verfügbares Lernmaterial • Siehe Angaben in den Studienbriefen |
| 12 | Sonstige Informationen ./. |
| 13 | Verwendung des Moduls (in anderen Studiengängen) ./. |

| FRM 32 Corporate Governance und Risikomanagement | | | | |
|--|--|---------------|-----------------------|--|
| Modulnummer | Workload | Credits | Zertifikatssemester | Dauer |
| FRM 32 | 150 h | 5 | 1. Sem. | 1 Semester |
| | Kontaktzeit | Selbststudium | Geplante Gruppengröße | Häufigkeit des Angebots |
| | 8 h | 142 h | je 4 - 20 Studierende | Jedes Semester (1 Lehrveranstaltung pro Semester) |
| 1 | Lehrveranstaltung des 1. Zertifikatssemesters | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Corporate Governance und Risikomanagement | | | |
| 2 | Lernziele | | | |
| | <p>Den Studierenden sind die Elemente ordnungsmäßiger Geschäftsführung und des aktienrechtlichen Geschäftsführungsrahmens vertraut. Ihnen sind die Komponenten einer ordnungsmäßigen Geschäftsführungsorganisation nach Maßgabe des Deutschen Corporate Governance Kodexes geläufig. Sie beherrschen Elemente und Ausgestaltung des Geschäftsführungsinstrumentariums sowie die Normen ihrer Prüfung auf Angemessenheit und Wirksamkeit.</p> <p>Die Studierenden wissen um die theoretischen Grundlagen des Anti-Fraud- bzw. Compliance Managements und der internen Überwachung und können diese in die Unternehmenspraxis umsetzen. Sie sind über die Aufgaben der Abschlussprüfung und den Ablauf der Prüfungsplanung orientiert. Sie beherrschen die Grundzüge des sog. „risikoorientierten Prüfungsansatzes“ und dessen Auswirkungen für die Praxis.</p> <p>Sie erlernen anhand von Fallbeispielen, Risiko- und Überwachungssysteme zu implementieren, um unternehmensgefährdende Entwicklungen früh zu erkennen, die Einhaltung der Geschäftspolitik zu unterstützen sowie die Zuverlässigkeit der betrieblichen Prozesse unter Beachtung des Wirtschaftlichkeitsprinzips zu sichern.</p> <p>Sie können anhand von Unternehmensbeispielen die Funktionsweise von Risikomanagementsystemen beurteilen und optimieren. Zudem beherrschen sie, Missstände vorhandener Systeme anhand risikoorientierter Prüfungshandlungen aufzudecken.</p> | | | |
| | Kompetenzen | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Sach- und Methodenkompetenz • Analytisches und abstrahierendes Denkvermögen • Wirtschaftliches Denken und Handeln • Fähigkeit zur Komplexitätsreduktion und zur Entwicklung von Ursache-Wirkungs-Beziehungen • Erarbeitung von Handlungsalternativen und deren problembezogene Evaluation • Fähigkeit zum Theorie-Praxis-Transfer • Entwicklung von Führungskompetenzen • Fähigkeit zur Anfertigung wissenschaftlicher Arbeiten. | | | |
| 3 | Inhalte | | | |

| | |
|-----------|---|
| | <p>Aktienrechtliches Organisationsmodell der Geschäftsführung. Aufgaben des Vorstands und Ausgestaltung der Sorgfaltspflicht. Haftungs- und Entlastungsprobleme.</p> <p>Grundsätze ordnungsmäßiger Geschäftsführung (§ 53 GenG, § 53 HGrG). Anforderungen an Geschäftsführungsorganisation, -instrumente, -tätigkeit. Prüfungsnormen der Ordnungsmäßigkeit (IDW PS 720). Deutscher Corporate Governance Kodex.</p> <p>Compliance Management-System: Ursachen und Indizien von fraud, Konzepte, Aufbau und Elemente des Anti-fraud- bzw. Compliance-Systems (IDW PS 980).</p> <p>Frühwarnsystem: Begriff und Ziele, Festlegung von Beobachtungsbereichen, Operationalisierung durch Frühwarnindikatoren, Sollwerte und Toleranzgrenzen, Festlegung der Informationsverarbeitung und -weiterleitung.</p> <p>Internes Überwachungssystem: Begriff und Ziele; Kontrollumfeld und Kontrollbewusstsein als Grundlage; prozessintegrierte und prozessunabhängige Überwachung. Die Rolle der gesetzlichen Abschlussprüfung (IDW PS 210, 261, 982, 983).</p> <p>Risikomanagementsystem: Begriff, Rechtsgrundlagen (§ 91 Abs. 2 AktG, § 317 Abs. 4 HGB), Aufbau- und Ablauforganisation, Informations- und Kommunikationssystem, Reportingsystem. Prüfungsnormen der Ordnungsmäßigkeit (IDW PS 340, 981).</p> |
| 4 | <p>Lehrformen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Selbstständige Bearbeitung der Studienbriefe, Literaturstudium • Fragend-entwickelnder Unterricht • Rechen- und Übungsbeispiele sowie praxisbezogene Fallstudien • Online-Betreuung, diverse E-Learning-Angebote. |
| 5 | <p>Teilnahmevoraussetzungen</p> <p>Formal: Zulassung zum Zertifikatsstudium Inhaltlich (zur Vorbereitung der Präsenzveranstaltung):</p> <ul style="list-style-type: none"> • Kenntnis der Studienbriefe • Durchsicht des online-verfügbaren Lehrmaterials. |
| 6 | <p>Prüfungsleistung (Art, Umfang)</p> <p>Klausur (60 Minuten)</p> |
| 7 | <p>Zugelassene Hilfsmittel in Klausuren</p> <p>Taschenrechner entsprechend den Richtlinien des Fachbereiches.</p> |
| 8 | <p>Voraussetzungen für die Vergabe von Kreditpunkten</p> <p>Bestehen der Prüfungsleistung (mindestens 50% der Gesamtpunktzahl)</p> |
| 9 | <p>Stellenwert der Note für die Endnote</p> <p>Gewichtung: 5/90</p> |
| 10 | <p>Modulverantwortlicher/Lehrender</p> <p>Prof. Dr. Mathias Graumann</p> |
| 11 | <p>Studienbriefe/sonstige Literatur</p> <ul style="list-style-type: none"> • Corporate Governance, Compliance und Risikomanagement Teil 1; Graumann; 2. Aufl. 2021 |

| | |
|-----------|--|
| | <ul style="list-style-type: none">• Corporate Governance, Compliance und Risikomanagement Teil 2; Graumann; 2. Aufl. 2021• Zusätzlich online-verfügbares Lernmaterial.• Weiterführende Literatur entsprechend den Angaben in den Studienbriefen. |
| 12 | Sonstige Informationen Hinweis: Bitte sehen Sie folgende Dateien überblicksartig durch und bringen sie zweckmäßigerweise zum Präsenzunterricht mit: AUFS_GF-PRUEF.pdf (2 Teile), AUFS_RMS.pdf und FS_RMS_Caterer.pdf (2 Teile). Es wird empfohlen, Taschenrechner zu den Veranstaltungen mitzubringen. |
| 13 | Verwendung des Moduls (in anderen Studiengängen) ./. |

| FRM 21 Portfoliotheorie | | | | |
|-------------------------|--|---------------|-----------------------|--|
| Modulnummer | Workload | Credits | Zertifikatssemester | Dauer |
| FRM 21 | 150 h | 5 | 2. Sem. | 1 Semester |
| | Kontaktzeit | Selbststudium | Geplante Gruppengröße | Häufigkeit des Angebots |
| | 8 h | 142 h | je 4-20 Studierende | Jedes Semester (1 Lehrveranstaltung pro Semester) |
| 1 | Lehrveranstaltung des 2. Zertifikatssemesters | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Portfoliotheorie | | | |
| 2 | Lernziele | | | |
| | <p>Nach dem Studium dieses Modul können die Studierenden</p> <ul style="list-style-type: none"> • die Funktionsweise und Struktur unseres Geldsystems verstanden haben und Reformvorschläge, wie etwa das Vollgeld-System, verstehen, einordnen und bewerten, • die in der Praxis verbreiteten Ein- und Mehr-Perioden-Modelle, insbesondere das Binomialbaum-Modell als wichtigsten Vertreter, zur Bewertung von Derivaten kalibrieren und einsetzen, • die Grundlagen der Portfoliotheorie, insbesondere das Konzept der Diversifikation von Risiken, verstanden haben und im Rahmen des CAPM zur Bewertung von Investitionen praktisch anwenden, • die Kennzahlen Value-at-Risk und Expected Shortfall verstanden haben und interpretieren • und anhand dieser Kennzahlen die Marktrisiken von Portfolios einschätzen. <p>Kompetenzen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Sach- und Methodenkompetenz • Analytisches Denkvermögen • Wirtschaftliches Denken und Handeln • Fähigkeit zur Komplexitätsreduktion und zur Entwicklung von Ursache-Wirkungs-Beziehungen • Erarbeitung von Handlungsalternativen und deren Evaluation in Problemsituationen • Fähigkeit zum Theorie-Praxis-Transfer • Entwicklung von Führungskompetenzen • Fähigkeit zur Anfertigung wissenschaftlicher Arbeiten | | | |
| 3 | Inhalte | | | |
| | <p>In diesem Modul werden Finanzinstrumente hinsichtlich ihrer Eigenschaften und Bewertungen beleuchtet. Neben verschiedenen Kapitalmarkt-Produkten und Derivaten werden auch die Struktur unseres Geldsystems, einige Funktionsprobleme und der Reformvorschlag Vollgeld diskutiert. Die Preisbildung verschiedener Klassen für die Praxis wichtiger Finanzprodukte mithilfe arbitragefreier Replikationsstrategien ist auch für das Risikomanagement grundlegend, und es lassen sich aus diesen Bewertungsverfahren Absicherungs-Strategien zur Kontrolle finanzieller Risiken ableiten. In der Praxis treten Finanzprodukte in der Regel gebündelt als Portfolios auf.</p> | | | |

| | |
|-----------|--|
| | Das Modul bietet daher eine Einführung in die klassische Portfoliotheorie und in das Capital Asset Pricing Model (CAPM). Es werden Aspekte des aktiven Portfoliomanagements unter Berücksichtigung der Risikopräferenzen der Investoren behandelt. Die Quantifizierung von Marktrisiken wird auf Basis des Value-at-Risk-Ansatzes für ausgewählte Kapitalmarktprodukte erläutert und es wird diskutiert, wie das Marktrisiko eines Portfolios nach Risikofaktoren und Risikofaktortypen aufgeschlüsselt und analysiert werden kann. Abschließend werden kohärente Risikomaße und deren prominentester Vertreter, der Expected Shortfall, diskutiert. |
| 4 | Lehrformen <ul style="list-style-type: none"> • Selbstständige Bearbeitung der Studienbriefe, Literaturstudium • Fragend-entwickelnder Unterricht • Zahlreiche Rechen- und Übungsbeispiele • Praxisbezogene Fallstudien • Online-Betreuung, diverse E-Learning-Angebote |
| 5 | Teilnahmevoraussetzungen Formal: Zulassung zum Zertifikatsstudium Inhaltlich (zur Vorbereitung der Präsenzveranstaltung): <ul style="list-style-type: none"> • Kenntnis des Studienbriefs • Der Studienbrief „Quantitative Methoden“ sollte vorab bearbeitet worden sein, da einige Begriffe und Konzepte aus diesem Studienbrief verwendet werden. |
| 6 | Prüfungsleistung (Art, Umfang) Klausur (60 Minuten) |
| 7 | Zugelassene Hilfsmittel in Klausuren Nicht-programmierbarer Taschenrechner gemäß den Richtlinien des Fachbereiches |
| 8 | Voraussetzungen für die Vergabe von Kreditpunkten Bestehen der Prüfungsleistung (mindestens 50% der Gesamtpunktzahl). |
| 9 | Stellenwert der Note für die Endnote Gewichtung: 5/90 |
| 10 | Modulverantwortlicher/Lehrender Prof. Dr. Jürgen Kremer |
| 11 | Studienbriefe/sonstige Literatur <ul style="list-style-type: none"> • Portfoliotheorie, Marktrisiken und die Bewertung von Derivaten; Kremer; 2. Aufl. 2022 • Zusätzlich online-verfügbares Lernmaterial • Siehe Angaben in den Studienbriefen |
| 12 | Sonstige Informationen ./. |
| 13 | Verwendung des Moduls (in anderen Studiengängen) ./. |

| FRM 41 Enterprise Risk Management | | | | |
|--|---|-------------------------------|---|--|
| Modulnummer | Workload | Credits | Zertifikatssemester | Dauer |
| FRM 41 | 180 h | 6 | 2. Sem. | 1 Semester |
| | Kontaktzeit 16 h | Selbststudium 164 h | Geplante Gruppengröße je 4-20 Studierende | Häufigkeit des Angebots Jedes Semester (2 Lehrveranstaltungen pro Semester) |
| 1 | Lehrveranstaltungen des 2. Zertifikatssemesters | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Enterprise Risk Management • Ausgewählte branchenspezifische Risikomanagement-Themen | | | |
| 2 | Lernziele | | | |
| | <p><i>Enterprise Risk Management</i></p> <p>Nach der Lektüre des Studienbriefs und dem Besuch der dazugehörigen Veranstaltung können die Studierenden u. A.</p> <ul style="list-style-type: none"> • beschreiben, wie das Spannungsfeld zwischen Risiko und Profit eines Unternehmens zustande kommt und wie sich der Unternehmer in diesem Spannungsfeld optimal positionieren kann, • Verfahren anwenden, auf deren Grundlage man beurteilen kann, ob das vorhandene Eigenkapital eines Unternehmens ausreicht, um eine Insolvenz mit hoher Wahrscheinlichkeit zu vermeiden, • beurteilen, welche Entscheidungen zu treffen sind, um den Marktwert des Eigenkapitals eines Unternehmens langfristig zu steigern, • die zentralen Resultate der Kapitalmarkttheorie darlegen und in den Gesamtkontext einordnen, • sowohl in formaler als auch in inhaltlicher Hinsicht definieren, was ein Risikomaß ist. Sie sind mit den Eigenschaften eines kohärenten Risikomaßes vertraut und in der Lage, diese Eigenschaften selbständig zu verifizieren oder zu falsifizieren. <p><i>Ausgewählte branchenspezifische Risikomanagement-Themen</i></p> <p><u>Teil 1: Informationstechnologie</u></p> <p>Nach dem Studium dieser Kurseinheit können die Studierenden</p> <ul style="list-style-type: none"> • die Grundlagen des IT-Risikomanagements verstehen, • die verschiedenen Begriffe und Methoden kompetent verwenden und diskutieren, • die regulatorischen Zusammenhänge im Anwendungsbereich von Software als Medizinprodukt kennen, selbstständig recherchieren und argumentieren, • die Ziele des IT-Risikomanagements in der Praxis umsetzen und aktiv verfolgen. <p>Risikomanagement in allgemeinen IT-Projekten</p> <ul style="list-style-type: none"> • Motivation und Definition von IT-Risikomanagement • Gesetzliche Rahmenbedingungen und Gründe für IT-Risikomanagement • Phasen des Risikomanagements <p>Risikomanagement bei Medizinprodukten</p> | | | |

| | |
|---|---|
| | <ul style="list-style-type: none"> • Der regulatorische Rahmen • Bedeutung des Risikomanagements • Verfahren zur Risikoanalyse • Risikomanagement bei Software als Medizinprodukt <p><u>Teil 2: Pharmazie</u></p> <p>Die Teilnehmenden verstehen, weshalb für Gesundheit als „besonderes Gut“ besondere Marktgesetze gelten. Sie erkennen, dass pharmazeutische Unternehmen bei der Entwicklung neuer Arzneimittel Gefahr laufen, keine Marktzulassung zu erhalten. Ebenso kennen sie die Risiken, die nach der Markteinführung in der Produktion und Anwendung der Medikamente auftreten. Sie können Strategien entwickeln, um diese Risiken zu minimieren. Die gesetzlichen Eingriffe bei der Festlegung von Preisen für Medikamente und deren Auswirkung auf den Unternehmensgewinn sind ihnen bekannt.</p> <p><u>Teil 3: Energiemarkt</u></p> <p>Nach dem Studium dieser Kurseinheit können die Studierenden</p> <ul style="list-style-type: none"> • die wesentlichen Unterschiede von Energie- zu Finanzmärkten erläutern, • den Unterschied zwischen Spotmarkt und Terminmarkt definieren, • einige typische Handelsprodukte in Energiemärkten aufzählen und beschreiben, sowie deren Eignung zum Einsatz als Hedge in verschiedenen Situationen bewerten, • Börsenhandel, bilateralen Handel und Handel über den Broker gegenüberstellen, • an Beispielen analysieren, wie verschiedene Akteure in Energiemärkten (z.B. Airlines, Kraftwerksbetreiber, etc.) von Preisrisiken betroffen sind, • anhand derselben Beispiele mögliche Hedgingstrategien konstruieren und erläutern. <p>Kompetenzen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Sach- und Methodenkompetenz • Analytisches Denkvermögen • Wirtschaftliches Denken und Handeln • Fähigkeit zur Komplexitätsreduktion und zur Entwicklung von Ursache-Wirkungs-Beziehungen • Erarbeitung von Handlungsalternativen und deren Evaluation in Problemsituationen • Fähigkeit zum Theorie-Praxis-Transfer • Entwicklung von Führungskompetenzen |
| 3 | <p>Inhalte</p> <p><i>Enterprise Risk Management</i></p> <p>Jedes Unternehmen birgt Risiken. Auf der einen Seite möchte der Unternehmer Risiken minimieren, auf der anderen Seite strebt er jedoch eine Gewinnmaximierung an. Damit befindet er sich in einem Zielkonflikt. Er bewegt sich nicht nur permanent in einem Spannungsfeld zwischen Risiko und Profit, sondern muss zudem dafür Sorge tragen, dass das vorhandene Eigenkapital des Unternehmens ausreicht, um die aus den Investitionsprojekten resultierenden Risiken zu tragen. Die Eigenkapitalgeber des Unternehmens erwarten außerdem, dass der Wert ihrer Anteile am Unternehmen langfristig steigt, insbesondere wenn es sich um eine börsennotierte Gesellschaft handelt.</p> |

In diesem Kurs gehen wir der Frage nach, wie ein Unternehmer risikobewusste und wertorientierte Entscheidungen treffen kann. Es werden Methoden zur Messung von Unternehmensrisiken vorgestellt und die Grundlagen einer risikoadjustierten Bewertung von Unternehmen vermittelt. Risikoadjustierung bildet die Basis einer wertorientierten Unternehmenssteuerung. Hierbei verfolgt Enterprise Risk Management einen ganzheitlichen Ansatz. Im Gegensatz zum traditionellen Risikomanagement werden die Risiken einzelner Abteilungen oder Geschäftsbereiche nicht unabhängig voneinander betrachtet. Vielmehr berücksichtigt man die Auswirkung einzelner Investitionsprojekte auf das Gesamtrisiko des Unternehmens. Das Ziel besteht darin, Diversifikationspotenziale zu nutzen und den Unternehmenswert durch das bewusste Eingehen erwünschter Risiken zu steigern. Gleichzeitig muss der Unternehmer jedoch dafür Sorge tragen, dass die Kapitaldecke des Unternehmens hinreichend stark ist, um eine Insolvenz zu vermeiden.

Wir diskutieren verschiedene Risikobegriffe und rekapitulieren elementare Regeln der Wahrscheinlichkeitsrechnung. Ebenso gehen wir auf fundamentale Resultate der Kapitalmarkttheorie ein. Letztere bilden die Grundpfeiler unserer heutigen Sicht auf das Risiko. Außerdem beschäftigen wir uns mit der Frage, wie wir Risiken überhaupt messen können und lernen einige wichtige Risikomaße kennen. Risikomaße sollten bestimmten Anforderungen genügen. Sind diese Anforderungen erfüllt, so sprechen wir von einem kohärenten Risikomaß. Zudem erörtern wir, wie wir das Gesamtrisiko eines Unternehmens in seine Bestandteile zerlegen können, vorausgesetzt, wir verwenden ein kohärentes Risikomaß.

Darüber hinaus erörtern wir verschiedene Kapitalbegriffe, wobei für uns das sogenannte ökonomische Kapital eine besondere Bedeutung hat. Wir werden diverse Methoden zur Ermittlung des ökonomischen Kapitals kennenlernen und anhand von Fallbeispielen diskutieren. Wir gehen der Frage nach, wie ein Unternehmer das vorhandene Kapital optimal einsetzen kann, lernen zudem verschiedene Erfolgsmaße kennen und diskutieren deren Vor- und Nachteile. Wir beschäftigen uns mit dem COSO-Regelwerk, bevor wir uns den Kapitalkosten eines Unternehmens widmen. Diese bilden die Grundlage für die Berechnung des Kapitalwerts von Investitionsentscheidungen, welcher sich als wesentliches Instrument einer wertorientierten Unternehmenssteuerung entpuppt. Wir schließen den Kurs mit Fallstudien aus der Praxis ab.

Ausgewählte branchenspezifische Risikomanagement-Themen

Teil 1: Informationstechnologie

Die Relevanz und Notwendigkeit von Risikomanagement steht mittlerweile außer Frage, wie verschiedene Studien zum Verlauf und Erfolg von IT-Projekten eindrucksvoll belegen. Dies gilt vor allem auch für den IT-Bereich, im Besonderen beim Einsatz von Software als Medizinprodukt: hier ist das gesamte Risikomanagement in einer „regulatorischen Landschaft“ rechtlich eingebettet.

Im Rahmen dieser Kurseinheit werden die allgemeinen IT-Prozesse zum Risikomanagement definiert und im Kontext der regulatorisch-normativen Anforderungen u.a. für Medizinprodukte detailliert. Dabei bildet der typische Regelkreislauf aus Identifikation, Analyse mit Bewertung, Behandlung und Überwachung von Risiken die Basis, der sich in der ISO-Norm 14971 zur „Anwendung des Risikomanagements auf Medizinprodukte“ für diese Branche unmittelbar wiederfindet. Hierin eingeführte und verwendete Begriffe wie Gefährdung, Risiko, Schäden (Schadensklassen und -kategorien) und Wahrscheinlichkeiten werden anhand von Beispielen erarbeitet sowie typische Verfahren zur Risikoanalyse (z. B.

| | |
|----------|--|
| | <p>PHA, FMEA, FTA) motiviert, angewendet und im Zusammenhang mit weiteren Normen und Richtlinien diskutiert.</p> <p><u>Teil 2: Pharmazie</u></p> <p>Ausgehend von den Besonderheiten des pharmazeutischen Marktes werden die Risiken bei der Entwicklung und beim Vertrieb von Medikamenten dargestellt. Die gesetzlichen Regeln für das Gesundheitswesen haben erheblichen Einfluss auf den Zulassungsprozess für neue Medikamente. Auch die Produktionsprozesse werden schärfer von Behörden überwacht als in anderen Branchen. Schließlich ist die Preisbildung in hohem Maße gesetzlich reglementiert.</p> <p><u>Teil 3: Energiemarkt</u></p> <p>In dieser Kurseinheit wird am Beispiel des Energiemarktes dargestellt, wie Preisänderungs-risiken beim Einkauf bzw. Absatz mit Hilfe eines aktiven Risikomanagements reduziert werden können. Um die speziellen Risiken in Energiemärkten besser zu verstehen, werden zunächst wesentliche Unterschiede von Energiemärkten, insbesondere Strommärkten, zu Finanzmärkten erläutert. Danach wird eine Auswahl von Handelsprodukten, die sich für das Risikomanagement im Energiemarkt eignen, kurz vorgestellt. Zuletzt wird ausführlich an Beispielen illustriert, wie mit Hilfe der vorgestellten Handelsprodukte Preisrisiken gemindert werden können.</p> |
| 4 | <p>Lehrformen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Selbstständige Bearbeitung der Studienbriefe, Literaturstudium • Fragend-entwickelnder Unterricht • Zahlreiche Rechen- und Übungsbeispiele • Praxisbezogene Fallstudien • Online-Betreuung, diverse E-Learning-Angebote |
| 5 | <p>Teilnahmevoraussetzungen</p> <p>Formal: Zulassung zum Zertifikatsstudium</p> <p>Inhaltlich (zur Vorbereitung der Präsenzveranstaltung):</p> <p><i>Enterprise Risk Management</i></p> <p>Der Studienbrief „Enterprise Risk Management“ bildet die Grundlage für diesen Kurs. Dieser Studienbrief und die dazugehörige Präsenzveranstaltung vermitteln den gesamten Inhalt des Kurses und sind somit für die Klausurvorbereitung völlig ausreichend. Nichtsdestotrotz steht dieser Kurs nicht für sich allein. Er sollte vielmehr als integrativer Bestandteil des gegebenen Curriculums betrachtet werden. Die methodischen Grundlagen für diesen Kurs werden in anderen Kursen des Studienschwerpunktes Financial Risk Management gelegt. Der Studienbrief „Enterprise Risk Management“ rekapituliert allerdings die wichtigsten Resultate.</p> <p><i>Ausgewählte branchenspezifische Risikomanagement-Themen</i></p> <p>Modul „Quantitative Methoden“, allg. Grundverständnis zu IT-(Software-)Projekten sinnvoll</p> |
| 6 | <p>Prüfungsleistung (Art, Umfang)</p> <p>Klausur (120 Minuten)</p> |
| 7 | <p>Zugelassene Hilfsmittel in Klausuren</p> <p>Es sind keine Hilfsmittel zugelassen.</p> |

| | |
|-----------|--|
| 8 | Voraussetzungen für die Vergabe von Kreditpunkten Bestehen der Prüfungsleistung (mindestens 50% der Gesamtpunktzahl der Modulklausur). |
| 9 | Stellenwert der Note für die Endnote Gewichtung: 6/90 |
| 10 | Modulverantwortliche Prof. Dr. Gabriel Frahm Dr. Matthias Raspe Lehrende Prof. Dr. Gabriel Frahm Prof. Dr. Manfred Berres Prof. Dr. Markus Neuhäuser Dr. Matthias Raspe |
| 11 | Studienbriefe/sonstige Literatur <ul style="list-style-type: none"> • Enterprise Risk Management; Frahm; 1. korr. Aufl. 2019 • Ausgewählte branchenspezifische Risikomanagement-Themen, Teil 1: Informationstechnologie; Raspe; 2. Auflage 2021 • Ausgewählte branchenspezifische Risikomanagement-Themen, Teil 2: Pharmazie; Berres, Neuhäuser; 1. Auflage 2017 • Zusätzlich online-verfügbares Lernmaterial • Siehe Angaben in den Studienbriefen. |
| 12 | Sonstige Informationen ./. |
| 13 | Verwendung des Moduls (in anderen Studiengängen) ./. |

| FRM 42 Regulierung von Finanzdienstleistungen | | | | |
|---|--|---------------|-----------------------|--|
| Modulnummer | Workload | Credits | Zertifikatssemester | Dauer |
| FRM 42 | 150 h | 5 | 2. Sem. | 1 Semester |
| | Kontaktzeit | Selbststudium | Geplante Gruppengröße | Häufigkeit des Angebots |
| | 8 h | 142 h | je 4-20 Studierende | Jedes Semester (1 Lehrveranstaltung pro Semester) |
| 1 | Lehrveranstaltung des 2. Zertifikatssemesters | | | |
| | <ul style="list-style-type: none"> • Regulierung von Finanzdienstleistungen | | | |
| 2 | Lernziele Nach dem Studium dieser Kurseinheit können die Studierenden <ul style="list-style-type: none"> • die Architektur der Banken- und Versicherungsregulierung in Europa darlegen; wesentliche rechtliche Grundlagen, insbesondere den Gesetzgebungsprozess sowie die relevanten Protagonisten der Regulierung erläutern und voneinander abgrenzen; • neue aufsichtliche Entwicklungen im Banken- und Versicherungsbereich nachvollziehen, in den Gesamtkontext einordnen und eigenständig hinsichtlich Auswirkungen und Bedeutung beurteilen; • wesentliche Steuerungsinstrumente für das Management von Risiken auf konkrete Fragestellungen anwenden und kritisch hinterfragen. Kompetenzen <ul style="list-style-type: none"> • Sach- und Methodenkompetenz • Analytisches Denkvermögen • Wirtschaftliches Denken und Handeln • Fähigkeit zur Komplexitätsreduktion und zur Entwicklung von Ursache-Wirkungs-Beziehungen • Erarbeitung von Handlungsalternativen und deren Evaluation in Problemsituationen • Fähigkeit zum Theorie-Praxis-Transfer • Entwicklung von Führungskompetenzen • Fähigkeit zur Anfertigung wissenschaftlicher Arbeiten | | | |
| 3 | Inhalte Das Modul gibt einen Überblick über aktuelle aufsichtsrechtliche Vorgaben für Unternehmen der Finanzdienstleistungsbranche und stellt die Struktur des europäischen Gesetzgebungsprozesses vor. Das 3-Säulen-Prinzip der Banken- und Versicherungsregulierung („Basel III / Basel IV“ bzw. „Solvency II“), welches auf Mindest-Eigenkapital- und Liquiditätsvorschriften, einer adäquaten internen Risikosteuerung seitens der Institute sowie einer öffentlichen Berichterstattung basiert, wird den Studierenden anhand von Praxisbeispielen nahegebracht. Ebenso werden die wesentlichen Ziele und Inhalte der europäischen „Bankenunion“, der einheitliche Aufsichtsmechanismus und die Beaufsichtigung systemrelevanter Banken durch die EZB (Single Supervisory Mechanism, „SSM“), | | | |

| | |
|----------|---|
| | <p>sowie der einheitliche Abwicklungsmechanismus („Single Resolution Mechanism, „SRM“) verdeutlicht.</p> <p>Prozessuale und aufbauorganisatorische Anforderungen an Banken und Versicherungen werden im Kontext der Mindestanforderungen an das Risikomanagement (MaRisk / MaGo), dem Konzept der Risikotragfähigkeit sowie dem „ORSA“-Prozess bei Versicherungen (Own Risk and Solvency Assessment) erarbeitet und es werden ausgewählte Organisationseinheiten (u.a. Risiko Controlling, Marktfolge, Aktuariat, versicherungstechnische Funktion) und ihre Verantwortlichkeiten vorgestellt.</p> |
| 4 | <p>Lehrformen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Selbstständige Bearbeitung der Studienbriefe, Literaturstudium • Fragend-entwickelnder Unterricht • Zahlreiche Rechen- und Übungsbeispiele • Praxisbezogene Fallstudien • Online-Betreuung, diverse E-Learning-Angebote |
| 5 | <p>Teilnahmevoraussetzungen</p> <p>Formal: Zulassung zum Zertifikatsstudium</p> <p>Inhaltlich (zur Vorbereitung der Präsenzveranstaltung):</p> <ul style="list-style-type: none"> • Kenntnis des Studienbriefs sowie der Grundzüge/Begrifflichkeiten aus den Studienbriefen „Corporate Governance, Compliance und Risikomanagement“, „Quantitative Methoden“ und „Portfoliotheorie, Marktrisiken und die Bewertung von Derivaten“). |
| 6 | <p>Prüfungsleistung (Art, Umfang)</p> <p>Hausarbeit. Zu Beginn des Semesters wird eine Themenliste ausgehändigt. Im Präsenztermin werden die einzelnen Themen darüber hinaus kurz vorgestellt. Eigene Themenvorschläge sind ebenfalls möglich. Diese müssen einen konkreten Bezug zur Veranstaltung haben. Sie sollten die prinzipielle Vorgehensweise kurz schriftlich schildern und erläutern, worin Ihre „eigene Arbeit“ bestehen wird. Der letzte Ausgabetermin wird rechtzeitig bekanntgegeben. Die Bearbeitungsdauer beträgt maximal 8 Wochen. Der tatsächliche Ausgabetermin der Hausarbeit wird schriftlich festgehalten sowie der letztmögliche Abgabetermin vermerkt. Die Anmeldung ist verbindlich, eine zu spät oder nicht abgegebene Arbeit wird mit einer 5,0 bewertet.</p> <p>Der Umfang der Arbeit sollte mindestens 16 Textseiten, maximal 50 Textseiten (Schriftgröße 12) betragen. Zu den Textseiten gehören weder das Deckblatt, die Verzeichnisse (Inhalt, Abbildungen, Abkürzungen, Tabellen, Literatur) noch der Anhang.</p> <p>Weitere Informationen zu Vorgaben die Hausarbeit betreffend sind im Dokument „Vorgaben für Hausarbeiten im Modul ‚Regulatorische Grundlagen des Finanzdienstleistungssektors‘“ zu finden.</p> <p>Die Arbeit ist per Email in elektronischer Form als PDF-Datei an brueck@hs-koblenz.de zu senden.</p> |
| 7 | <p>Zugelassene Hilfsmittel in Klausuren</p> <p>Es sind keine Hilfsmittel zugelassen.</p> |
| 8 | <p>Voraussetzungen für die Vergabe von Kreditpunkten</p> <p>Bestehen der Prüfungsleistung</p> |

| | |
|-----------|---|
| 9 | Stellenwert der Note für die Endnote Gewichtung: 5/90 |
| 10 | Modulverantwortliche/Lehrende Prof. Dr. Martina Brück |
| 11 | Studienbriefe/sonstige Literatur <ul style="list-style-type: none">• Regulatorische Grundlagen des Finanzdienstleistungssektors; Brück, Apwisch; 2. Auf. 2020• Zusätzlich online-verfügbares Lernmaterial• Siehe Angaben in den Studienbriefen |
| 12 | Sonstige Informationen ./. |
| 13 | Verwendung des Moduls (in anderen Studiengängen) ./. |