

Vertiefungsgebiet Finanzierung

Modul: Risikomanagement

Qualifikationsziele: Die Studierenden sollen erkennen, dass sich Marktrisiken mit Hilfe von Terminkontrakten prinzipiell beherrschen lassen. Sie sollen die Eigenschaften von Standardkontrakten sicher beurteilen können und Fähigkeiten entwickeln, über den Einsatz solcher Instrumente selbständig zu entscheiden. Sie sollen dazu in die Lage versetzt werden, den Wert von Terminpositionen präferenzfrei zu berechnen. Schließlich sollen die Studierenden mit wichtigen Konzepten dynamischen Hedgings vertraut gemacht werden.

Inhalte: Motive für den Einsatz von Terminkontrakten (Hedging, Spekulation, Arbitrage), Institutioneller Hintergrund, Grundlegende Preisbeziehungen, Diskrete Bewertungsmodelle, Basis, Backwardation und Contango, Hedging mit Futures, Black-Scholes-Formel, The Greeks, Exotische Optionen

Die vorangehende Absolvierung des Moduls „Investition und Finanzierung“ wird empfohlen.

Lehr- und Lernformen	Präsenzstudium (Semesterwochenstunden = SWS)	Arbeitsaufwand insgesamt (Stunden)	Formen aktiver Teilnahme
Vorlesung	2	Präsenzzeit Vorlesung (30) Präsenzzeit Übung (30)	Beantwortung von Diskussionsfragen, Stellungnahme zu Thesen
Übung	2	Vor- und Nachbereitung des Stoffes (60) Bearbeitung von Übungsaufgaben (30) Prüfungsvorbereitung und -bearbeitung (30)	Bearbeitung von Fallstudien und Übungsaufgaben

Veranstaltungssprache: Deutsch

Arbeitszeitaufwand/h insgesamt: 180

Dauer des Moduls: ein Semester

Häufigkeit des Angebots: Mindestens jedes Wintersemester

Modul: Risikomanagement		
Zugangsvoraussetzungen: Keine.		
Lehr- und Lernformen	Modulprüfung	Pflicht zu regelmäßiger Teilnahme
Vorlesung	Klausur oder Multiple-Choice-Test (Bearbeitungsdauer: 120 Minuten). An die Stelle einer Klausur bzw. eines Multiple-Choice-Tests können mehrere Tests mit gleicher Gesamtbearbeitungsdauer treten.	Teilnahme wird empfohlen
Übung		Teilnahme wird empfohlen
Leistungspunkte: 6		