

Modulnummer F12	Modultitel Finanzrisikomanagement (Financial Risk Management)		
Kurzbezeichnung FRM	Semester 1/2	Anzahl der SWS 4	Häufigkeit des Angebots jedes Studienjahr (SoSe)
Modulverantwortlich Prof. Dr. Hößl	Veranstaltungstyp Seminaristischer Unterricht		Dauer des Moduls 1 Semester
Dozent Prof. Dr. Hößl	Art der Lehrveranstaltung Pflichtmodul in der Vertiefungsrichtung FACT		Lehrsprache Deutsch
Zugangsvoraussetzungen Grundkenntnisse im Investition/Finanzierung, Finanzcontrolling, Finanzierungsinstrumente sowie in Investitionsmanagement/Unternehmensbewertung werden vorausgesetzt.			
Qualifikationsziele Im Einzelnen haben die Studierenden nach Abschluss des Moduls auf Basis wissenschaftlicher Methoden die folgenden Lernziele erreicht: <u>Fachkompetenz</u> Die Studierenden kennen die Bedeutung des Managements unternehmerischer Risiken sowie den hierbei zugrundeliegenden Prozess. Sie sind mit den einzelnen Prozessschritten vertraut und sind in der Lage, hierbei adäquate Methoden anzuwenden und kritisch zu beurteilen. Die Studierenden sind in der Lage, das Chancen- und Risikoprofil derivativer Finanzinstrumente verlässlich einzuschätzen und Derivate gezielt zur Absicherung gegen unternehmerische Risiken einzusetzen. Sie kennen die verschiedenen Risikoarten und beherrschen gängige Verfahren der Risikomessung und -bewertung. Sie sind in der Lage, Risiken genau abzugrenzen sowie sie gezielt zu messen um sie, sofern erforderlich, geeignet zu steuern. <u>Methodenkompetenz</u> Die Studierenden sind in der Lage, Fragestellungen des unternehmerischen Risikomanagements zu analysieren und zu beurteilen. Sie beherrschen Techniken zur Identifikation, Bewertung und Steuerung von Risiken und können diese analysieren und bewerten. Sie sind in der Lage, theoretische Überlegungen in Bezug auf Entscheidungen des Risikomanagements in der Praxis umzusetzen. Die Studierenden sind befähigt, Derivate zu bepreisen und im Rahmen der Risikosteuerung strategisch einzusetzen. <u>Sozialkompetenz</u> Die Studierenden besitzen die Fähigkeit, im Teamrahmen erfolgreich zu agieren. Sie weisen Kommunikationsvermögen auf und sind zur konstruktiven Kritik befähigt. Die Studierenden sind in der Lage, Diskussionen zu führen und Ergebnisse strukturiert vor einer Zuhörerschaft zu präsentieren. <u>Persönliche Kompetenz</u> Die Studierenden sind in der Lage, eigenständig Problemstellungen des betrieblichen Risikomanagements zu bewältigen und Lösungsansätze kritisch zu diskutieren. Sie sind sich der finanzwirtschaftlichen Folgen ihrer Entscheidungen bewusst und so in der Lage, diese in ihr eigenes Wertesystem einzubauen.			
Inhalt der Lehrveranstaltung <ul style="list-style-type: none"> • Grundlagen des Riskomanagements und betrieblicher Risikomanagementprozess 			

- Risikoidentifikation
- Risikoanalyse und -bewertung
- Risikosteuerung und -kontrolle
- Derivative Finanzinstrumente im Kontext des Risikomanagements
- Steuerung finanzwirtschaftlicher Risiken
- Grundlagen der Steuerung leistungswirtschaftlicher Risiken

Literatur

Pflichtliteratur

Bösch, Martin: Derivate. Verstehen, anwenden und bewerten. München: Vahlen.

Cottin, Claudia; Döhler, Sebastian: Risikoanalyse. Modellierung, Beurteilung und Management von Risiken mit Praxisbeispielen. Wiesbaden: Springer Fachmedien (Studienbücher Wirtschaftsmathematik).

Diederichs, Marc: Risikomanagement und Risikocontrolling. München: Vahlen.

Gleißner, Werner: Grundlagen des Risikomanagements. Mit fundierten Informationen zu besseren Entscheidungen. Verlag C.H. Beck; Vahlen.

Hull, J, Optionen Futures und andere Derivate, München; Boston, Mass. [u.a.]

Kruse, Susanne: Aktien-, Zins- und Währungsderivate. Märkte, Einsatzmöglichkeiten, Bewertung und Risikoanalyse. Wiesbaden: Springer Fachmedien.

Romeike, Frank; Hager, Peter: Erfolgsfaktor Risiko-Management 3.0. Methoden, Beispiele, Checklisten; Praxishandbuch für Industrie und Handel. Wiesbaden: Springer Gabler.

Stocker, Klaus: Management internationaler Finanz- und Währungsrisiken. Mit Übungen und Lösungen. Wiesbaden: Springer Gabler (Lehrbuch).

Wengert, Holger Michael; Schittenhelm, Frank Andreas: Corporate Risk Management. Berlin [u.a.]: Springer Gabler (Lehrbuch).

Wolke, Thomas (2016): Risikomanagement. Berlin, Boston: de Gruyter Oldenbourg.

Zusätzlich empfohlene Literatur

Bloss, Michael: Währungsderivate. Praxisleitfaden für ein effizientes Management von Währungsrisiken. München: Oldenbourg.

Borghesi, Antonio; Gaudenzi, Barbara: Risk management. How to assess, transfer, and communicate critical risks. New York: Springer.

Broll, Udo; Wahl, Jack E.: Risikomanagement im Unternehmen. Real- und finanzwirtschaftlicher Ansatz für internationale Unternehmen und Finanzintermediäre. Wiesbaden: Springer Gabler.

Chapman, Robert J.: Simple tools and techniques for enterprise risk management. Chichester, England, Hoboken, N.J.: Wiley (Wiley finance).

García, Francisco Javier Población: Financial Risk Management. Identification, Measurement and Management. Springer Science and Business Media; Palgrave Macmillan.

Geyer, Christoph; Uttner, Volker: Praxishandbuch Börsentermingeschäfte. Erfolgreich mit Optionen, Optionsscheinen und Futures. Wiesbaden: Gabler.

Hull, J, Optionen Futures und andere Derivate, Übungsbuch, München; Boston, Mass. [u.a.]

Rosenkranz, Friedrich; Missler-Behr, Magdalena: Unternehmensrisiken erkennen und managen. Einführung in die quantitative Planung. Berlin [u.a.]: Springer.

Rudolph, B., Schäfer, K., Derivative Finanzinstrumente, Eine anwendungsbezogene Einführung in Märkte, Strategien und Bewertung

<p>Skoglund, Jimmy: Risk Management. Applications in Market, Credit, Asset and Liability Management and Firmwide Risk.</p> <p>van Deventer, Donald R.; Imai, Kenji; Mesler, Mark: Advanced financial risk management. Tools and techniques for integrated credit risk and interest rate risk management. Singapore: Wiley.</p> <p>jeweils in aktueller Auflage</p>		
<p>Lehr- und Lernmethoden</p> <p>Seminaristischer Unterricht</p> <p>Vortrag durch Dozenten mittels Präsentationsfolien unter Bereitstellung eines Skriptums</p> <p>Eigenverantwortliche Übungen mit Korrekturhilfen und bereitgestellten Excel-Arbeitsblättern</p> <p>Erarbeitung von Inhalten anhand von Aufsätzen aus Fachzeitschriften, Fallstudien und Artikeln zu aktuellen Themen</p> <p>Bereitstellung von Vorlesungsmaterialien und Excel-Übungsdateien in E-Learning/Moodle</p> <p>Einüben und Umsetzung der besprochenen und diskutierten theoretischen Inhalte und Modelle anhand einer Excel-Übung im CIP-Pool</p>		
<p>Art der Prüfung/Voraussetzung für die Vergabe von Leistungspunkten</p>		<p>Klausur</p> <p>Dauer: 90 Minuten</p>
<p>Besonderes</p>		<p>-</p>
<p>ECTS-Credits</p> <p>5</p>	<p>Gesamtarbeitsaufwand</p> <p>150 Stunden</p> <p>Kontakt/Präsenzzeit: 60 h</p> <p>Studentische Eigenarbeit: 90 h</p>	<p>Gewichtung der Note in der Gesamtnote</p> <p>1</p>