



Inhalte des Studiengangs Risk Management & Treasury (M. Sc.)

1. Semester (Kompaktkurse*)

Entscheidungsorientiertes Management

- Klassische Entscheidungslehre
- Managemententscheidungen aus psychologischer Sicht
- Entscheidungen im Strategiekontext

Finanzwirtschaftliche Quantitative Methoden

- Finanzwirtschaftliche und statistische Grundlagen
- Ökonometrie
- Wertpapierbewertung
- Risikomessung
- Simulationsmethoden

Finanzmarktaufsicht und -regulierung

- Grundlagen
- Theorie der Regulierung
- Organisation der Finanzmarktaufsicht
- Überblick über regulatorische Bestimmungen
- Versicherung von Risiken
- Die Finanzkrise - Ursachen und regulatorische Konsequenzen
- Regulatorisches Reporting
- Ethische Aspekte der Finanzmarktaufsicht und Regulierung

2. Semester (Kompaktkurse*)

Schlüsselkompetenzen

- Corporate Governance & Corporate Social Responsibility
- Verhandlungs- und Moderationstraining

Wissenschaftliche Methodik und Forschungsforum

- Wissenschaftstheoretische Grundlagen
- Qualitative und quantitative Forschung
- Verfahren der quantitativen Forschung
- Verfahren der quantitativen Datenanalyse

Projekt: IT-Management im Bereich Risk Management & Treasury

Liquiditätsrisikomanagement

- Liquiditäts- und Effizienz-Messkonzepte
- Preisbildung auf illiquiden Märkten
- Ermittlung und Management von Fungibilitätsabschlägen auf regulierten und unregulierten Kapitalmärkten
- Trading-Strategien in liquiden und illiquiden Märkten
- Notwendigkeit und Auswirkungen regulatorischer Eingriffe auf die Wertpapierliquidität

3. Semester (Kompaktkurse*)

Zinsrisikomanagement

- Zinsstrukturkurven und ihre Erzeugung (Bootstrapping)
- Typisierung, Messung und Hedging von Zinsänderungsrisiken
- Bewertung von asymmetrischen und symmetrischen Zinsprodukten
- Zinsmargenrisiken und strategische Implikationen

Projekt Kreditrisikomanagement

- Methoden der Kreditrisikomessung (wie Credit Value at Risk und Stress Test)
- Marktimplizite Ratings
- Ausfallkorrelationen und Kreditportfoliomodelle
- Kreditrisikotransfer: Verbriefung (z.B. Asset Backed Securities), Kreditderivate (z.B. Credit Default Swaps)

Management von Währungs- und sonstigen Risiken

- Systematisierung und Hedging von Währungsrisiken
- Wechselkurssysteme, -theorien und -prognosemodelle
- Informationsgehalt von Währungsoptionen
- Rohstoff(preis)risiken, Wetterrisiken
- Verhaltensökonomische Ansätze zur Erklärung von Markttrends

Projekt: Angewandtes Risiko- und Treasurymanagement

4. Semester

Master-Thesis und Kolloquium (zzgl. Exposé und Thesis Day)

* Kompaktkurse zum individuellen Kompetenzaufbau: Frischen Sie Ihr Wissen studienbegleitend in kostenlosen Kompaktkursen (Präsenzveranstaltungen/eLearning) zu studiengangsbearbeiteten Fachthemen auf.

** Transfer Assessment: Die Studierenden werden kontinuierlich dabei unterstützt, die Studieninhalte in ihre eigene berufliche Praxis zu übertragen. Durch verschiedene Methoden analysieren die Studierenden die Anwendbarkeit des Gelernten sowie ihre persönliche Kompetenzentwicklung.