

<b>Modul-Nr./ Code</b>	<b>42120 / LV 42322</b>
Modulbezeichnung	Finanzderivate und Risikomanagement (Finanzierung und Investition C)
Semester/ Trimester	Drittes Semester
Dauer des Moduls	Ein Semester
Art der Lehrveranstaltung (Pflicht, Wahl etc.)	Pflichtmodul
Ggfs. Lehrveranstaltungen des Moduls*	Entfällt
Häufigkeit des Angebots des Moduls	Jedes Semester
Zugangsvoraussetzungen	Keine
Verwendbarkeit des Moduls für andere Module und Studiengänge	Aufgrund der speziellen inhaltlichen Ausrichtung des Master-Studiengangs nur für den Studien- gang Master of Arts in Finance verwendbar.
Modulverantwortlicher/ Modulverantwortliche	Prof. Dr. Beißer
Name der/ des Hochschullehrer/s	Prof. Dr. Beißer
Unterrichts-/ Lehrsprache	Deutsch
Zahl der zugeteilten ECTS-Credits	6
Gesamtworkload und ihre Zusammen- setzung (z. B. Selbststudium + Kontaktzeit)	180 Stunden Plenumsveranstaltungen: 60 Std. Selbststudium, Vor- und Nachbereitung: 120 Std.
SWS	4 SWS
Art der Prüfung/ Voraussetzung für die Vergabe von Leistungspunkten	Klausur
Gewichtung der Note in der Gesamtnote	4,4%
Qualifikationsziele des Moduls	<ul style="list-style-type: none"> <li>• grundlegendes Verständnis der Risiken auf den Finanzmärkten entwickeln</li> <li>• verschiedener Risikomanagementstrategien sicher anwenden</li> <li>• wichtigste Finanzderivate verschiedener Assetklassen und ihre Anwendung im Risikomanagement verstehen</li> <li>• Wissen integrieren und wissenschaftlich</li> </ul>

	<p>fundierte Entscheidungen treffen</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• mit Komplexität und Abstraktion umgehen</li> <li>• Wissen und Fähigkeiten zur Problemlösung auch in neuen und unvertrauten Situationen anwenden können</li> <li>• selbständige Problemanalyse, strukturiertes Denken und Entwerfen von Lösungsansätzen</li> <li>• mit Fachvertretern und Laien über Inhalte, Ideen, Probleme und Lösungen austauschen können</li> </ul>
Inhalte des Moduls	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Finanzmärkte (Organisation der Finanzmärkte, Zinsen, Duration, Konvexität)</li> <li>2. Zinsderivate und Risikomanagement (Forward, Futures, Swap, Caps, Floors, Swaption)</li> <li>3. Aktienderivate und Risikomanagement (Plain Vanilla Optionen; Auszahlungsprofile, verteilungsunabhängige Wertgrenzen, Optionsstrategien, Binomialmodell, Black Scholes Modell, Sensitivitäten)</li> <li>4. FX Derivate und Risikomanagement (Cross Currency Swap, FX Optionen, Exotische Optionen)</li> <li>5. Kreditderivate und Risikomanagement (CDS, CDO, NTD)</li> <li>6. Finanzinnovationen (Zertifikate, Aktienanleihen)</li> </ol>
Lehr- und Lernmethoden des Moduls	Vorlesung mit Übungen
Besonderes (z. B. Online-Anteil, Praxisbesuche, Gastvorträge, etc.)	Gastvorträge
<b>Literatur</b> (Pflichtlektüre/ zusätzlich empfohlene Literatur)	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Büschgen, H.E. (1997): Internationales Finanzmanagement, 3. Auflage, Fritz Knapp, Frankfurt.</li> <li>• Briys, E.; M. Bellalah; H.M. Mai; F. de Varenne (1998): Options, Futures and Exotic Derivatives, John Wiley&amp;Sons, Chichester.</li> <li>• Hull, J.C. (2001): Optionen, Futures und andere Derivate, 4. Auflage, Oldenbourg, München.</li> <li>• Mehring, G.W. (1996): Zins- und Währungsmanagement im Unternehmen, Economica, Bonn.</li> <li>• Perridon, L.; M. Steiner (2007): Finanzwirtschaft der Unternehmung, 14. Auflage, Vahlen, München.</li> <li>• Rudolph B.; K. Schäfer (2005): Derivative Finanzinstrumente, Springer, Berlin 2005.</li> </ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Sandmann, K. (2001): Einführung in die Stochastik der Finanzmärkte, 2. Auflage, Springer, Berlin.</li> <li>• Steiner, M; Ch. Bruns (2002): Wertpapiermanagement, 8. Auflage, Schäffer-Poeschel, Stuttgart.</li> <li>• Trautmann, S. (2006): Investitionen, Springer, Berlin.</li> </ul>
--	--