



# Risikomanagement und Kapitalmarkt

**Titel des Moduls:**

Risikomanagement und Kapitalmarkt

**Leistungspunkte:**

6

**Verantwortliche Person:**

Hirth, Hans

**Sekretariat:**

H 64

**Ansprechpartner:**

Hirth, Hans

**Webseite:**
<http://www.finanzen.tu-berlin.de>
**Anzeigesprache:**

Deutsch

**E-Mail-Adresse:**
[sekretariat@finanzierung.tu-berlin.de](mailto:sekretariat@finanzierung.tu-berlin.de)

## Lernergebnisse

Die Studierenden werden dafür sensibilisiert, auf die nachhaltige Rationalität von Entscheidungen unter Risiko zu achten. Sie sind in der Lage, Risiken zu erfassen und Ausfall- sowie Risikoprämien zu kalkulieren. Im Rahmen eines modernen Portfoliomanagements können sie zwischen systematischen und unsystematischen Risiken unterscheiden und diese Risiken bewerten. Sie lernen Finanzinstrumente kennen, die ein effektives Risikomanagement erlauben, und können diese Instrumente fair bewerten. Absolventen des Moduls werden auf Tätigkeiten in der Finanzwirtschaft vorbereitet. Klassische Einsatzgebiete sind die betriebliche Finanzwirtschaft, das Investment sowie die Kredit- und Versicherungswirtschaft.

## Lehrinhalte

Im Rahmen der Lehrveranstaltungen zu Risikomanagement & Kapitalmarkt geht es um die Gestaltung des Risikomanagements sowie die Analyse von Kapitalmärkten. Vorgestellt werden die entscheidungstheoretischen Grundlagen für rationales Verhalten unter Risikosituationen. Darauf aufbauend werden Ansätze für die korrekte Messung von Ausfall- und Risikoprämien hergeleitet. Für das Management solcher Risiken existieren unterschiedlichste Finanzinstrumente. Deren charakteristische Eigenschaften werden analysiert und auf ihre jeweilige Eignung für ein effektives Risikomanagement untersucht. In diesem Kontext werden die folgenden konkreten Probleme behandelt: systematische und unsystematische Risiken im Rahmen des Portfolio-Managements, die Performance-Messung und ihre Schwächen, die Bewertung von Aktien, Anleihen, Forwards, Futures, Optionen und Swaps sowie die Möglichkeiten, mit deren Hilfe finanzwirtschaftliche Risiken und realwirtschaftliche Investitionen abzusichern.

## Modulbestandteile

Lehrveranstaltungen	Art	Nummer	Turnus	SWS
Risikomanagement und Kapitalmarkt	VL	72 130 L 1453	WS	2
Risikomanagement und Kapitalmarkt	UE	72 130 L 1454	WS	2

## Arbeitsaufwand und Leistungspunkte

Risikomanagement und Kapitalmarkt (Vorlesung)	Multiplikator	Stunden	Gesamt
Präsenzzeit	15.0	2.0h	30.0h
			30.0h
Risikomanagement und Kapitalmarkt (Übung)	Multiplikator	Stunden	Gesamt
Präsenzzeit	15.0	2.0h	30.0h
			30.0h
Lehrveranstaltungsunabhängiger Aufwand	Multiplikator	Stunden	Gesamt
Prüfungsvorbereitung	1.0	60.0h	60.0h
Vor-/Nachbereitung	15.0	4.0h	60.0h
			120.0h

Der Aufwand des Moduls summiert sich zu 180.0 Stunden. Damit umfasst das Modul 6 Leistungspunkte.

## Beschreibung der Lehr- und Lernformen

Es werden verschiedene Lehrformen verwendet. Es kommen Vorlesungen und Übungen zum Einsatz.

## Voraussetzungen für die Teilnahme / Prüfung

**Wünschenswerte Voraussetzungen für die Teilnahme an den Lehrveranstaltungen:**

Es bestehen keinerlei Voraussetzungen zur Teilnahme am Modul.

**Verpflichtende Voraussetzungen für die Modulprüfungsanmeldung:**

Keine Angabe

## Abschluss des Moduls

<b>Benotung:</b> benotet	<b>Prüfungsform:</b> Schriftliche Prüfung	<b>Sprache:</b> Deutsch	<b>Dauer/Umfang:</b> 90 Minuten
-----------------------------	--	----------------------------	------------------------------------

## Dauer des Moduls

Dieses Modul kann in einem Semester abgeschlossen werden.

## Maximale teilnehmende Personen

Dieses Modul ist nicht auf eine Anzahl Studierender begrenzt.

## Anmeldeformalitäten

Zur Teilnahme am Modul ist keine Anmeldung erforderlich.

## Literaturhinweise, Skripte

<b>Skript in Papierform:</b> <i>nicht verfügbar</i>	<b>Skript in elektronischer Form:</b> verfügbar
--	--

## Zugeordnete Studiengänge

Dieses Modul wird auf folgenden Modullisten verwendet:

### Economics (Bachelor of Science)

StuPO 2008

Modullisten der Semester: SS 2018 WS 2018/19 SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020 WS 2020/21

### Industrial Economics (Master of Science)

StuPo 2018

Modullisten der Semester: SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020

### Information Systems Management (Wirtschaftsinformatik) (Master of Science)

StuPO 2017

Modullisten der Semester: SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020 WS 2020/21

### Nachhaltiges Management (Bachelor of Science)

StuPo 2013

Modullisten der Semester: SS 2018 WS 2018/19 SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020 WS 2020/21

### Nachhaltiges Management (Bachelor of Science)

StuPo 2016

Modullisten der Semester: SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020

### Volkswirtschaftslehre (Bachelor of Science)

StuPo 2018

Modullisten der Semester: WS 2018/19 SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020

### Wirtschaftsinformatik (Bachelor of Science)

BSc Wirtschaftsinformatik StuPO 2015

Modullisten der Semester: SS 2018 WS 2018/19 SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020 WS 2020/21

### Wirtschaftsingenieurwesen (Bachelor of Science)

StuPO 2015

Modullisten der Semester: SS 2018 WS 2018/19 SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020

### Wirtschaftsingenieurwesen (Master of Science)

StuPO 2015

Modullisten der Semester: SS 2018 WS 2018/19 SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020

### Wirtschaftsmathematik (Bachelor of Science)

Bachelor Wirtschaftsmathematik 2014

Modullisten der Semester: SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020 WS 2020/21

### Wirtschaftsmathematik (Master of Science)

StuPO 2014

Modullisten der Semester: SS 2019 WS 2019/20 SoSe 2020 WS 2020/21

## Sonstiges

*Keine Angabe*