



# MARMARA UNIVERSITÄT - Fakultät für Betriebswirtschaftslehre

Betriebswirtschaftslehre (in Deutscher Sprache)

## SYLLABUS

Vorlesungscode	Name der Vorlesung		Vorlesungstyp	Vorlesungsgruppe * für Wahlfächer	Semesterwochenstunden (SWS)		ECTS	Voraussetzungsveranstaltung mindestnote in Buchstaben-format
					T	P		
FNCE4062	Finanzielles Risikomanagement		Pflichtfach		3	0	5	
Voraussetzung			Mindestnote in Buchstaben-format				Note	
Veranstaltungssprache								
Vortragende/-r								
Lehrinhalt								
Folgende Themen werden innerhalb der Vorlesung angefasst; finanzielles Risiko und Management, Risikoberechnung, Hedgeinstrumente auf den verschiedenen Märkten, betriebliche "Hedge" Strategien, Landrisiko, Internationales finanzielles Risikomanagement.								
Lernziele der Vorlesung								
Das Ziel dieser Vorlesung ist die Anfassung der finanziellen Risikomanagement und Hedgeinstrumente auf den derivaten und anderen finanziellen Märkten.								
Empfohlene oder Pflichtliteratur	1.	1) Christoffersen, P. F. (2011) Elements of Financial Risk Management, 2nd edition, Academic Press. 2) John, F. (2000) Value at Risk: The Benchmark for Managing Market Risk, 3rd Edition, McGraw-Hill. 3) Shapiro, A. C. Multinational Financial Management, 10th Edition, Wiley. 4)						
Lernergebnisse	1.	Herrschaft in den finanzielles Risiko und Management						
	2.	Begabung für die Lösung der "Pricingprobleme" in bezug auf finanzielles Risikomanagement auf den verschiedenen Märkten						
	3.	Begabung für Prozessbewertung und Analyse in bezug auf finanzielles Risiko						
	4.	Herrschaft in den betrieblichen "Hedging" Strategien						
	5.	Begabung für die Strategien auf den derivaten Märkten						
Geplante Lernaktivitäten und Lehrmethoden								
WOCHE	Datum	Veranstaltungsinhalt						
Woche 1		Risiko Konzept, Risiko Typen und der Bedarf für finanzielles Risikomanagement						
Woche 2		Risiko Berechnung I - Wert im Risiko (VAR)						
Woche 3		Risiko Berechnung II - Wert im Risiko (VAR)						
Woche 4		Risikomanagement und Derivaten I - Forwards						
Woche 5		Risikomanagement und Derivaten II - Futures						
Woche 6		Risikomanagement und Derivaten III - Options						
Woche 7		Risikomanagement und Derivaten IV - Swaps						
Woche 8		Zwischenprüfung/-en						
Woche 9		FX Risikomanagement auf den Devisenmärkten						
Woche 10		Kreditrisikomanagement						
Woche 11		Liquiditätsrisikomanagement						
Woche 12		Betriebliches Finanziellesrisikomanagement und "Hedging" I						
Woche 13		Betriebliches Finanziellesrisikomanagement und "Hedging" II						
Woche 14		Landrisiko						
Woche 15		Internationales Risikomanagement						
Woche 16		Studienwoche						
Woche 17		Finalprüfung						
Aktivitäten und Kriterien		Aktivitäten	Anzahl	Dauer		Gewichtung im (%)	Gewichtung in der Semester Bewertung (%)	
		Finalprüfung	1			50	0	
		Wiederholungsprüfung	1			50	0	
		Semester Bewertung				50	100	
		Zwischenprüfung/-en	1			50	100.0	
		Quiz						
		Projekt/-e						

		Aufgabe/-n					
		Labor					
		Sonstige					
*** ECTS Leistungspunkte und Arbeitsaufwand ***							
Bewertungsinstrument	Stunden/Anzahl	Studentische Arbeitsaufwand		Bewertungsinstrument	Anzahl	Studentische Arbeitsaufwand	
Theorie	3.0	42.0		Quiz & Vorbereitung	10	10.0	
Praxis	0.0	0.0		Hausaufgaben			
Labor				Projekt			
Selbststudium vor der Veranstaltung	1.0	14.0		Forschung und Präsentation			
Selbststudium nach der Veranstaltung	2.0	28.0		Seminar			
Selbststudium nach der Bewertung				Feldstudie			
Borbereitung für die Klausur & Zwischenprüfung	10	10.0		Werkstatt			
Vorbereitung für die Klausur & Finalprüfung	20	20.0		Sonstige			
SUMME :					46.0	124.0	
Empfohlene ECTS -Punkte (Gesamtstunden / 25) :						5	