

Informationsveranstaltung Master Wiwi

Major: Finance

Prof. Dr. Marcel Prokopczuk, CFA

Institut für Finanzmarkttheorie

Beteiligte Institute am Major Finance

- Institut für Banken und Finanzierung
- Institut für Finanzmarkttheorie
- Institut für Geld und internationale Finanzwirtschaft
- Institut für Statistik
- Institut für Wirtschaftsinformatik

Köpfe



- Banken
- Versicherungen
- Unternehmensfinanzierung in Industrieunternehmen
- Beratungen
- Regulatoren (BaFin, Bundesbank, EZB, ...)
- Wirtschaftsprüfungen
- Universitäten

Aufbau

Modul	Lehrveranstaltung	Prüfungs- leistung	Sprache	ECTS	Institut
Financial Management	Asset Management (2 V)	Klausur 90 min	E	9	Geld und Internationale Finanzwirtschaft
	Risk Management (2 V + 2Ü)				Banken und Finanzierung
Asset Pricing	Asset Pricing (2 V + 1Ü)	Klausur 60 min	E	5	Finanzmarkttheorie
Seminar	Seminar zu quantitativen Methoden	Seminarleistung	E/D	5	Alle
Wahlpflichtmodul	Computational Finance (2V)	Hausarbeit	E	5	Wirtschaftsinformatik
	oder Statistical Methods in Finance (2V/Block)	mündl. Prüfung	E		Statistik

Prof. Dr. Steffen Meyer

- The Asset management industry
- Investment universe
- Asset management strategies
- Efficient portfolios with multiple assets
- Style analysis
- Performance measurement
- Backtesting of asset management strategies
- Value of active (fund) management
- Regulatory changes
- Threats from innovative financial products
- Behavioral Finance

Jun.-Prof. Dr. Sebastian Krimm

- Modelling and measuring interest rate risk
- Value at risk and expected shortfall
- Modelling and measuring volatility
- Economic capital and risk budgeting
- Risk management and company value

Prof. Dr. Marcel Prokopczuk, CFA

- Expected Utility and Risk Aversion
- Mean-Variance Analysis
- CAPM, Arbitrage and Factor Models
- Consumption-Savings Decisions and State Pricing
- Empirical Tests of Asset Pricing Models
- Derivatives Pricing
- Models of the Term Structure of Interest Rates

Prof. Dr. Michael Breitner, Jun.-Prof. Dr. Hans-Jörg von Mettenheim, Dennis Eilers

- Einführung in und Beispiele für Computational Finance
- Arbeit mit Finance Datenbanken und Big Data Analytics
- Künstliche Neuronale Netze und Neurosimulation (FAUN)
- Synthese großer, mehrdimensionaler, unstrukturierter Datensätze
- Zeitreihenprognosen (Neurosimulation vs. statistische Verfahren)
- Einführung in numerische Verfahren zur Lösung und Optimierung gewöhnlicher und partieller Finance Differentialgleichungen

Dr. Philipp Bertram

- Risk management and financial returns
- Historical simulation, Value-at-Risk and Expected Shortfall
- A primer on financial time series analysis
- Volatility modelling using daily data
- Volatility modelling using intraday data
- Non-normal distributions
- Covariance and correlation models
- Backtesting and stress testing

- Jedes der fünf beteiligten Institute bietet ein Seminar für den Major Finance an.
- Studierende haben die Wahlmöglichkeit aus einer breiten Palette von Themen und ein gutes Betreuungsverhältnis ist sichergestellt.
 - Seminar 1: **Banking and Finance** (Prof. Dr. Dierkes)
 - Seminar 2: **Quantitative Investment Management** (Prof. Dr. Prokopczuk)
 - Seminar 3: **Empirical Finance** (Prof. Dr. Meyer)
 - Seminar 4: **Computational Finance** (Prof. Dr. Breitner / Jun.-Prof. Dr. v. Mettenheim)
 - Seminar 5: **Quantitative Methods in Finance** (Dr. Bertram)

- Masterarbeit ist an jedem der beteiligten Institute möglich
- Durch die Beteiligung von 5 Instituten sind Themen aus jedem Bereich des Finance möglich
- Masterarbeiten in Zusammenarbeit mit Unternehmen sind nach Absprache möglich (Entscheidung liegt beim gewählten Prüfer)
- “Lange” 6-monatige Arbeit beste Voraussetzung für mögliche Promotion

Hannover Center of Finance e.V.

- Enge Kooperation mit Finance-Unternehmen aus der Region
- Gemeinsame Veranstaltungen auch für Studierende
- Vormerken: Hannover Finance Symposium am 7.11.2016



Fragen ?!

Kontakt:

prokopczuk@fmt.uni-hannover.de