

Fagmodulets navn	Den finansielle virksomheds risikostyring (landsobligatorisk 5 ECTS)
Er fagmodulet obligatorisk?	ja institutionsspecifikt.
Formål	Fagets formål er at give de studerende indblik i de regler og bestemmelser, der gælder for finansielle virksomheder, hvilket også betyder, at de skal have indblik i risici som finansielle virksomheder har påtaget sig.
Indhold	De forskellige finansielle virksomheder og deres opgaver behandles tillige med deres rolle i samfundsøkonomien. Centralbankens rolle såvel som reguleringen af de finansielle institutioner medinddrages. Der lægges særlig vægt på de forskellige typer risici: renterisiko, markedsrisiko, kreditrisiko, operationel risiko og likviditetsrisiko, såvel som på disse risicis samspil. Styringen af risici ved overvågning (fx stress tests), afdækning og direkte reduktion heraf indgår endelig med væsentlig vægt. Der er tale om forskningsbaseret undervisning ud fra et stillet pensum, der løbende ajourføres.
Læringsmål	Den studerende skal have indgående viden om de forskellige risici, som en finansiell virksomhed er udsat for, og hvilke muligheder og redskaber for risikostyring og afdækning af risiko der eksisterer. Den studerende skal have viden om de love og regler, nationale såvel som internationale, der regulerer finansielle virksomheders operationer. Den studerende skal have viden om hovedprincipperne for kapitaldækning og performancemåling i finansielle virksomheder.
<ul style="list-style-type: none"> • Viden 	
<ul style="list-style-type: none"> • Færdigheder 	Den studerende skal være kvalificeret til at kunne foretage værdiansættelser af balanceposter baseret på forskellige modeller. Den studerende skal være kvalificeret til at gennemføre beregninger af risici med henblik på, at en række styringsværktøjer såsom finansielle instrumenter kan bringes i anvendelse.
<ul style="list-style-type: none"> • Kompetencer 	Den studerende skal have kompetencer til at vurdere hvilke teorier, modeller, værktøjer m.v., der synes mest relevante i den konkrete situation. Den studerende skal have kompetencer til at vurdere hensigtsmæssigheden af en konkret organisatorisk forankring af risikostyringsfunktionen.
Pædagogisk valg	På 6. semester er der 8 timer ugentligt i 15 uger samt et antal øvelsestimer. Undervisningen i faget Den finansielle virksomheds risikostyring dækker cirka 1/3 af semesteret, og den gennemføres ved forelæsninger. I disse skabes et overblik over regelsættet omkring den finansielle virksomheds risikostyring, fagets teorier kombineret med praktiske problemstillinger. Der stilles i semesteret en obligatorisk godkendelsesopgave, og denne opgave gennemgås efterfølgende i øvelsesforløbet. En godkendelse af opgaven er en forudsætning for indskrivning til eksamen
Eksamensform	Eksamen er en 4 timers skriftlig eksamen. Om der er adgang til at anvende hjælpemidler besluttet af lærer og studieleder i forbindelse med undervisningens tilrettelæggelse. I tilfælde af omeksamen kan denne afholdes som mundtlig eksamen, såfremt studielederen vurderer, at dette er mest hensigtsmæssigt, fx fordi der kun er få tilmeldte. Eksamenen er således individuel. Bedømmelsen sker efter 7-trins skalaen. Der anvendes ekstern censur.