

Gültig ab 2025.FS

Modulbezeichnung: Aktives Investmentmanagement		
Modulkürzel	w.BA.XX.2AIM.XX	
ECTS Credits	6	
Unterrichts- und Prüfungssprache	Deutsch	
Beschreibung des Moduls	Die Studierenden kennen die Problemstellungen des Asset Managements und können die wichtigsten Finanzinstrumente, insbesondere auch alternative Anlagen, gezielt für Lösungsvorschläge in der Praxis umsetzen. Sie werden befähigt, die entsprechenden Anlageprozesse zu steuern und sind in der Lage, vernetzt zu denken. Sie kennen die schweizerische und weltweite Bedeutung von institutionellen Investoren, insbesondere Pensionskassen und Anlagefonds.	
Verantwortliche OE	Institut für Wealth & Asset Management	
Modulverantwortung	Marcus Wunsch	
Modulverantwortung Stellvertretung	Patrick Hauf	
Studiengang und Vertiefungsrichtung	<ul style="list-style-type: none">Betriebsökonomie - Vertiefung in Banking and Finance	
Rechtliche Grundlagen	Studienordnung BSc vom 29.01.2009 für die Bachelorstudiengänge Betriebsökonomie, International Management, Wirtschaftsinformatik, Wirtschaftsrecht und Angewandtes Recht, erstmals beschlossen am 12.05.2009	
Modulkategorie	Modultyp Pflichtmodul	Studienabschnitt Hauptstudium
Spezifische Vorkenntnisse	Grundlegende Kenntnisse in Finance, Mathematik, Bankwirtschaft, Portfoliotheorie sowie in Excel	
Beitrag des Moduls für Learning Objectives des Studiengangs (durch das Modul betroffene)	<ul style="list-style-type: none">FachkompetenzMethodenkompetenzSozialkompetenzSelbstkompetenz	
Beitrag des Moduls für Learning Objectives des Studiengangs	<p>Fachkompetenz</p> <ul style="list-style-type: none">Theorie- & Praxisrelevante Fachinhalte wissen & verstehenTheorie- & Praxisrelevante Fachinhalte anwenden, analysieren und verknüpfenTheorie- & Praxisrelevante Fachinhalte evaluieren <p>Methodenkompetenz</p> <ul style="list-style-type: none">Problemlösung & Kritisches DenkenWissenschaftliche MethodenArbeitsmethoden, -techniken & -verfahrenNutzung von InformationenKreativität & Innovation <p>Sozialkompetenz</p> <ul style="list-style-type: none">Schriftliche KommunikationMündliche KommunikationKooperation im Team & Umgang mit KonfliktenInterkulturalität & Perspektivenübernahme <p>Selbstkompetenz</p> <ul style="list-style-type: none">Selbstmanagement & SelbstreflexionEthische & Soziale VerantwortungLernen & Veränderung	

Modulbezeichnung: Aktives Investmentmanagement

Lernziele des Moduls	<p>Die Studierenden...</p> <ul style="list-style-type: none"> • kennen die Vor- und Nachteile des aktiven und passiven Asset Management und können mit verschiedenen Lösungsansätzen umgehen. • sind in der Lage, eine kotierte Aktie zu analysieren, um die faire Bewertung herzuleiten. • können die Performance Attribution als Zerlegung eines mehrstufigen Investmentprozesses erklären und quantitativ durchführen. • kennen wichtige quantitative Investmentstrategien, etwa CTA/Managed Futures und Risk Parity. • kennen die wichtigsten Auswahlkriterien sowie die Vor- und Nachteile der verschiedenen Anlagefondsformen (u.a. auch ETFs und Immobilienfonds). • kennen die Herausforderungen der schweizerischen Vorsorgeeinrichtungen. • wissen, wann, wie und weshalb Immobilienanlagen und Private Equity Investments eingesetzt werden. • können die verschiedenen psychologischen Effekte beim Investieren voneinander unterscheiden. • können Muster bei der Entwicklung von Marktpreisen einzelnen psychologischen Effekten zuordnen. • kennen die drei Hauptelemente (Kapitalallokation, Corporate Stewardship, Transparenz) des nachhaltigen Investierens. • kennen die möglichen Ziele (finanzieller Gewinn, Werte-Alignment, Impact) nachhaltiger Anlageansätze. • kennen die drei Dimensionen von ESG und können diese Elemente den verschiedenen nachhaltigen Anlageansätze zuordnen. • kennen die Grundzüge von Kryptoanlagen und der Decentralized Finance. 																												
Inhalte des Moduls	<ul style="list-style-type: none"> • Performance-Messung und deren Besonderheiten im aktiven Investment Management • Behavioral Finance • Theorien des aktiven Portfoliomanagement • Aktienbewertung • Anlagefonds • Alternative Anlagen wie Hedge Funds und Private Equity • Immobilien • Aktives und passives Asset Management: Herausforderungen in der Praxis • Institutionelle Anleger / Schweizer Pensionskassen • Bewertete schriftliche Semesterarbeit • Sustainable Investing 																												
Verknüpfung zu anderen Modulen	Das Modul weist eine Verknüpfung zu folgenden Modulen auf: <ul style="list-style-type: none"> • w.BA.XX.2QMeth.XX • w.BA.XX.2FIPT.XX 																												
Digitale Lernressourcen	<ul style="list-style-type: none"> • Übungs- und Anwendungsaufgaben (inkl. Lösungen) • Fallstudien (inkl. Lösungen) • (Multiple-Choice)-Tests 																												
Unterrichtsmethoden	<ul style="list-style-type: none"> • Lehrgespräch • Übungen • Fallstudien • Lehrvortrag • Literaturstudium • Anwendungsaufgaben • E-Learning 	Eingesetzte Sozialformen: <ul style="list-style-type: none"> • Einzelarbeit 																											
Unterrichtsgliederung	<table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>Kontaktstudium</th> <th>Begleitetes Studium</th> <th>Autonomes Selbststudium</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Grossklasse</td> <td>56 h</td> <td>56 h</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Kleinklasse</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Gruppenunterricht</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Praktikum</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Seminar</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Total</td> <td>56 h</td> <td>56 h</td> <td>68 h</td> </tr> </tbody> </table>		Kontaktstudium	Begleitetes Studium	Autonomes Selbststudium	Grossklasse	56 h	56 h		Kleinklasse	-	-		Gruppenunterricht	-	-		Praktikum	-	-		Seminar	-	-		Total	56 h	56 h	68 h
	Kontaktstudium	Begleitetes Studium	Autonomes Selbststudium																										
Grossklasse	56 h	56 h																											
Kleinklasse	-	-																											
Gruppenunterricht	-	-																											
Praktikum	-	-																											
Seminar	-	-																											
Total	56 h	56 h	68 h																										

Modulbezeichnung: Aktives Investmentmanagement

Leistungsnachweise	Modulendprüfung		Form	Dauer (Min.)	Gewichtung
	Schriftliche Prüfung		open book	60	65.00
	Hilfsmittel		freie Wahl Taschenrechner	Mit Diktionär	
	Andere	Bewertung	Format	Dauer (Min.)	Gewichtung
	Schriftliche Arbeit	Note	Einzelarbeit	0	35.00
Präsenzverpflichtung im Kontaktstudium	Keine				
Pflichtliteratur	<ul style="list-style-type: none"> • Skript • Artikel / Lehrbuchkapitel (sämtliche Ressourcen auf Moodle verfügbar) 				
Ergänzende Literatur	<ul style="list-style-type: none"> • Bodie, Z., Kane, A. & Marcus, A. (2013). Essentials of Investments. 9E Auflage. New York: McGraw-Hill. ISBN 13 9780077148249. Spätere Ausgaben sind auch zulässig. 				
Bemerkungen					