

Risikomanagement und Steuerung der Bank					
Risk and Return Management in Financial Institutions					
Modul-Nr.	Credits	Workload	Semester	Turnus	Dauer
074 070	5 CP	150 h	1.-3. Sem.	Winter	1 Semester
Lehrveranstaltungen			Kontaktzeit	Selbststudium	Gruppengröße
a) Vorlesung – <i>digital (synchron)</i>			a) 2 SWS	116,25 h	80
b) Übung – <i>digital (synchron)</i>			b) 1 SWS		Studierende
Unterrichtssprache			Teilnahmevoraussetzungen		
Deutsch			Kenntnisse aus dem Wahlpflichtmodul „Kapitalmarkttheorie“ werden vorausgesetzt.		
Anmeldeverfahren					
Die (freiwillige) Kursanmeldung erfolgt über die Lernplattform Moodle der Ruhr-Universität, die Anmeldung zur Prüfung über FlexNow innerhalb der vom Prüfungsamt bekanntgegebenen Fristen.					

Vertiefungen / Einordnungen			
Economic Policy Consulting MSc.			
	Pflichtmodul (20 ECTS)	X	International and Spatial Economics
	Empirical Economics		Umweltmanagement, Ressourcen und Energie
	Entrepreneurship, Innovation und Transformation	X	Wahlmodul

Management and Economics MSc.			
	Accounting & Auditing		Produktionswirtschaft
	Entrepreneurship, Innovation & Transformation		Development Economics
X	Banking & Finance		Statistics & Econometrics
	Governance Systeme		National Security Economics
	Betriebswirtschaftliche Steuerlehre		Theoretical & Applied Microeconomics
	International Finance		Energie- & Umweltökonomik
	Controlling		General Economics
	Sales & Innovation	X	General Management
	Data Science & Quantitative Analysis		

Finance, Accounting, Auditing, Controlling, & Taxation MSc.			
	Kernbereich (25 ECTS)	X	Finance
	Accounting		Auditing
	Controlling		Taxation
X	Wahlpflichtmodul (20 ECTS)	X	Wahlmodul (max. 15)

Sales Management MSc.			
	Pflichtmodul (45 ECTS)	X	Wahlmodul (max. 20 ECTS)
	Wahlpflichtmodul (min. 15 ECTS)		

Economics MSc.			
	Kern-Modul (30 ECTS)		Wahlbereich Economics (min. 75 ECTS)
	International Economics and Finance	X	Wahlbereich Management (max. 15 ECTS)
	Economic Policy		

Management MSc.			
X	Accounting, Finance, Taxation	X	Wahlbereich Management (min. 60 ECTS)
	Operations and Service Management		Wahlbereich Economics (max. 30 ECTS)
	Marketing		

Lernziele

Die Studierenden sollen

1. ein vertieftes Verständnis einzelner Risikokomplexe der Bank entwickeln,
2. den Einsatz fortgeschrittener quantitativer Verfahren zur Risikoanalyse und -steuerung kennenlernen,
3. die Verknüpfung von Rendite- und Risikomanagement im Rahmen der Wertorientierung durchdringen,
4. vor diesem Hintergrund die strategische und operative Steuerung der Bank verstehen,
5. dabei die relevanten Informationen des internen und externen Rechnungswesens heranziehen und
6. Performanceanalysen durchführen können

Inhalt

- Das Konzept der Risikotragfähigkeit
- Zentrale bankbetriebliche Risiken im Überblick
- Management von Adressausfallrisiken
- Management von Marktpreisrisiken
- Management von Liquiditätsrisiken
- Management von operationellen Risiken
- Banksteuerung und Risikokapitalallokation
- Berechnung risikoadjustierter Performancekennzahlen
- Rendite/Risiko-Steuerung

Lehrformen

Vorlesungen und Übung

Prüfungsformen

Die Modulabschlussnote ergibt sich aus der Note der Modulabschlussklausur.

Voraussetzungen für die Vergabe von Kreditpunkten

Kreditpunkte werden vergeben, wenn die Modulabschlussprüfung erfolgreich absolviert wurde.

Stellenwert der Note für die Endnote (bei einem Gesamtstudienumfang von 120 ECTS)

4,17 %

Modulbeauftragte/r und hauptamtlich Lehrende

Prof. Dr. Stephan Paul mit Assistentinnen und Assistenten

Lernmaterialien und Literaturangaben

Als Grundlagenliteratur werden folgende Quellen empfohlen:

- Hartmann-Wendels, Thomas/ Pfingsten, Andreas/ Weber, Martin (2019): Bankbetriebslehre, 7. Auflage., Berlin u.a.
- Koch, Timothy W./ MacDonald, S. Scott (2014): Bank Management, 8th ed., Mason, OH u.a.

- Horsch, Andreas/ Kaltoven, Daniel (2020): Wertorientierte Banksteuerung I: Renditemanagement, 3. Auflage., Wiesbaden.
- Schierenbeck, Henner / Lister, Michael / Kirmße, Stefan (2014): Ertragsorientiertes Bankmanagement: Band 2: Risiko-Controlling und integrierte Rendite-/Risikosteuerung, 9. Auflage., Wiesbaden.
- Wiedemann, Arnd (2013): Risikotriade. Band I: Zins-, Kredit-und operationelle Risiken, 3. Auflage, Frankfurt am Main 2013
- Wiedemann, Arnd / Wiechers, Sebastian (2013): Risikotriade. Band II: Integrierte Rendite-/Risikosteuerung im ökonomischen Kapitalkonzept, Frankfurt am Main 2013.

Weitere Literaturhinweise erfolgen in der ersten Veranstaltung

Sonstige Informationen

Keine