

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