

PD Dr. Hans Rau-Bredow

Vorlesung im WS 2016/2017 an der Universität Würzburg:

10 54 970 Grundlagen des bankbetrieblichen Risikomanagements Teil 2

Blockveranstaltung am **Freitag, 28. Oktober 2016, 11:15 – ca. 16 Uhr, Ort: Seminarraum 18**

Es handelt sich um den zweiten und letzten Teil der gleichnamigen Veranstaltung aus dem Sommersemester 2016. Eine Teilnahme ist grundsätzlich auch möglich, wenn Teil 1 nicht gehört wurde. Gegenstand sind die einzelnen bankbetrieblichen Risiken, also das Kreditrisiko, das Marktrisiko, das Liquiditätsrisikos und das operationellen Risiko. Aus dem Umfang des Stoffes ergibt sich, dass es sich nur um einen einführenden Überblick handeln kann, der aber hoffentlich den Einstieg erleichtert, wenn sich die Teilnehmer im weiteren Studienverlauf oder in der Praxis vertieft mit dieser Thematik auseinandersetzen müssen.

- Ein neuer Foliensatz speziell zu Teil 2 wird rechtzeitig unter www.rau-bredow.de und auf der Lehrstuhlhomepage bereitgestellt.
- Es können auch wieder Teilnahmenachweise ausgestellt werden; bitte senden Sie dazu Name und Matrikelnummer an hans.rau-bredow@uni-wuerzburg.de (Leider können keine ECTS-Punkte erworben werden; ein Leistungsnachweis ist nicht vorgesehen)

Gliederung

Grundlagen des bankbetrieblichen Risikomanagements Teil 2:
Die bankbetriebliche Risiken im Einzelnen

a) Kreditrisiko

- Gesamtbanksteuerung
- Mindesteigenkapitalanforderungen für Kreditrisiken
 - Kreditrisiko-Standardansatz (KSA)
 - Internal Ratings-Based (IRB) Approach
- Kreditrisikomodelle (Creditmetrics, CreditRisk+)

b) Marktrisiko

- Regulatorische Mindesteigenkapitalanforderung
 - Standardansatz (Zinsänderungsrisiko (Duration), Aktienkursrisiko, Optionen (Delta-Plus-Methode, Szenario-Matrix-Analyse), Währungs- und Rohstoffrisiko)
 - Interne Modelle (Value at Risk)
- Aktienkursrisiko, Value at Risk und Extremwerttheorie

c) Liquiditätsrisiko (Neue Kennzahlen in Basel III)

d) Operationelles Risiko

Literatur:

Hartmann-Wendels, Th., Pfingsten, A., Weber, M.: Bankbetriebslehre, 6. Auflage 2014

Hull, J. C.: Risk Management and Financial Institutions, 4th Edition 2015