

Risikomanagement

- **Modulinhalt**

Das Modul besteht aus zwei Teilen: dem funktionalen und dem institutionellen Risikomanagement. Im ersten Teil werden Risikomaße sowie die Bewertung klassischer Derivate am Finanzmarkt erlernt. Es werden insbesondere Futures/Forwards und Optionen betrachtet sowie deren Einsatzmöglichkeiten im Rahmen von finanziellem Risikomanagement. Im zweiten Teil liegt der Schwerpunkt in der Berücksichtigung aufsichtsrechtlicher Vorgaben für die Bewertung von Risiken im Bankensektor.

1. Teil: funktionales Risikomanagement

- i. Grundlagen und Risikomanagement-Prozess
- ii. Risikoquantifizierung
- iii. Termingeschäfte

2. Teil: institutionelles Risikomanagement

- i. Einführung in die bankbezogene Betrachtung
- ii. Kapital und Säule 1
- iii. Säule 2

- **Kompetenzbeschreibung**

Nach Abschluss des Moduls sind die Studierenden in der Lage,

- (i) Eignung und Probleme ausgewählter Risikomaße zu beurteilen;
- (ii) eigenständig den fairen Wert der behandelten Derivate zu berechnen;
- (iii) gängige Hedgingstrategien am Kapitalmarkt nachzuvollziehen und zu evaluieren.
- (iv) wesentliche Risiken im Bankensektor zu adressieren und ihre Behandlung anhand aufsichtsrechtlicher Vorgaben nachzuvollziehen.