

Modulverantwortlicher: Prof. Dr. Arnd Wiedemann

Lehrender: Prof. Dr. Arnd Wiedemann

Lehrender: Prof. Dr. Christoph Schmidhammer

Kreditrisikomanagement

Bankenaufsicht

- 1) Ratings
- 2) Ausfallwahrscheinlichkeiten und Credit Spreads
- 3) Kreditrisikomodell von Merton
- 4) Kreditderivate und Kreditverbriefungen

- 1) Eigenmittelanforderung im Rahmen von Basel III
- 2) Definition relevanter Kapitalkennziffern
- 3) Eigenmittelanforderungen an Kreditrisiken (Standardansatz und IRB-Ansatz)
- 4) Anrechnung von Sicherheiten

Sie erwerben vertiefte Kenntnisse im Management finanzieller Ressourcen. Sie verstehen die Bedeutung des Ausfallrisikos und beherrschen die wichtigsten Methoden, Techniken, Modelle, Instrumente und Institutionen des modernen Kreditrisikomanagements. So lernen und verstehen Sie die Arbeits- und Denkweise von Kreditrisikomanagern.

Sie lernen mit Basel III umzugehen. In besonderem Maße werden Sie darüber in Kenntnis gesetzt und methodisch angeleitet, welche qualitativen und quantitativen Eigenmittelanforderungen für Banken gemäß CRR einzuhalten sind. Darüber hinaus sind Sie mit Abschluss des Moduls in der Lage, den Standardansatz (KSA) und den internen Ansatz (IRBA) für die Eigenmittelunterlegung von Kreditrisiken anzuwenden und voneinander abzugrenzen, einschließlich der Anrechnung von Sicherheiten.