

## **Forschungsstrategie "Quantitative Asset and Risk Management" (ARIMA)**

Der Studiengang ARIMA beteiligt sich maßgeblich an der Bearbeitung des Forschungsfeldes „**Finanzmarktentwicklung und -regulierung**“. Als neues Forschungsfeld in diesem Bereich tut sich zurzeit der Themenkreis rund um „Regulatory Reporting/Meldewesen“ für Banken und Versicherungen auf. Die Auswirkungen der letzten Finanzkrise schlagen sich besonders im Meldewesen der Banken und Versicherungen nieder. Die neue europäische Bankenaufsicht (EBA, EZB) stellt hier die Weichen komplett neu: unter dem SSM (Single Supervisory Mechanism) sind nicht mehr nur die nationalen Behörden sondern vorrangig die EZB für die Aufsicht der Banken zuständig. Die Vorgaben im Meldewesen werden zentral von der EBA gesteuert, indem alle Reporting Templates von ihr entwickelt werden. Zurzeit wird auf internationaler Ebene bereits an den Vorgaben für Basel IV gearbeitet.

Auch die Entwicklungen im Bereich IFRS 9 (Rechnungslegungsstandards) sind in das Forschungsfeld einzubeziehen: es gibt nun mehr modellbasierte Bewertungsmethoden die auf finanzmathematischen und quantitativen Ansätzen beruhen.

Im neuen Forschungsfeld wird zurzeit an der 2. Auflage eines Buches mit dem Titel „Meldewesen für Finanzinstitute – was bringt die neue europäische Aufsicht?“ gearbeitet. Ziel dieses Buches ist es, PraktikerInnen und Personen aus Lehre und Forschung einen Überblick über die vielfältigen und laufend steigenden Anforderungen des Meldewesens für Finanzinstitute zu vermitteln. Weitere Forschungsfelder sind „Systemic and systematic risk in liquidity risk management“ und „Meldewesen für Pensionskassen“.

Neben den zwei genannten Forschungsprojekten wird sich die angewandte F&E des Studiengangs im Zuge weiterer Projekte (unter Einbindung der Studierenden im Rahmen ihrer Masterarbeit) der Umsetzung dieser Regelungen und der Optimierung bei Finanzdienstleistern widmen. In ARIMA gibt es auch einschlägige Lehrveranstaltungen zum Thema. Die Methoden und Ergebnisse angewandter Forschung können daher direkt in die Lehre von ARIMA einfließen.