

Banking, Pricing & Analytics

Dozent: Dr. Tobias Schlüter



Fokus

- Die Vorlesung gibt Ihnen einen tiefen Einblick in das **Pricing** der Banken und seine Verzahnung zu **Risikomanagement** und **Banksteuerung**.
- Sie erhalten einen breiten Einblick, wie die Finanzindustrie **KI**, **maschinelles Lernen** und **Analytics** nutzt.
- Sie erlernen die Analytics-Software **SAS** und wenden sie auf aktuelle Use Cases mit eigenen Datensätzen an.

Themenauswahl

- **Pricing im Banking**
- **Advanced Analytics & Predictive Modelling**
- **KI & maschinelles Lernen in Banken**
- **Gesamtbanksteuerung & Geschäftsplanung**
- **Ratingmodelle & Credit Pricing**
- **Asset Liability Matching**

Gastvorträge Wintersemester 2019/2020

Creda Rate

*„Interne Ratingmodelle
in der Banksteuerung“*

KI analytics

*„Analytics in der
Finanzindustrie“*



*Gemeinsam mit CredaRate und
SAS entwickeln lernen Sie ein
Ratingmodell zu entwickeln*

Fakten

Vorlesung 08.11. & 22.11.19 je von 09:00-17:00 Uhr,
Seminarraum 3, WiSo-Modulbau

6 Credit Points Klausur 06.12.2019, 10.00, und
Hausarbeit

Ihre Ansprechpartnerin am Bankseminar:
Ann-Christine Brunen,
Telefon: 0221 4702406,
Email: brunen@wiso.uni-koeln.de



Hausarbeiten – Überblick Themenfelder

Übung in Seminarraum 6.224 (OG6), Geb. 414 (Bernhard-Feilchenfeld-Straße 9, K-Zollstock).

08.01.2020 09:00-15:00
10.01.2020 13:00-17:00
15.01.2020 09:00-13:00
17.01.2020 13:00-17:30
22.01.2020 09:00-13:00

Empirisch: Customer Deposit Withdrawals

- Sichteinlagen stellen die wichtigste Refinanzierungsquelle deutscher Banken dar
- Kunden können ihre Sichteinlagen jederzeit abziehen und ein Liquiditätsrisiko hervorrufen
- Sie erhalten Daten zum Kundenverhalten im Sparbereich
- Zielbild: Erstellen Sie ein Forecast-Modell zum Kundenverhalten

Empirisch: Customer Default Prediction

- Das Kreditrisiko ist eine bedeutende Risikoart für Banken und die Prognose möglicher Kreditausfälle seit langem zentrale Fragestellung in der Kreditrisikomodellierung
- Sie erhalten Daten zu historischen Kreditausfällen und erstellen ein Prognosemodell, um zukünftige Ausfälle abschätzen zu können
- Zusammen mit Experten der in Köln ansässigen CredaRate erarbeiten sie ein Modell zur Bewertung von Kreditausfallrisiken mit SAS Enterprise Miner.

Theoretische Arbeiten:

- Customer Choice Prediction
- Robo-Advisors

Sie erhalten Feedback zu ihrer Hausarbeit als Vorbereitung auf die anstehende Masterarbeit.