

Laufende Forschungsprojekte der Lehrkräfte der Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe

Finance Alliance

- Ziel:** Förderung eines wissenschaftlichen Austausches der Wissenschaftler der Abteilung Finanzmathematik des Fraunhofer Institutes Techno- und Wirtschaftsmathematik (ITWM) mit der University of Cambridge, u.a. im Rahmen eines Wissenschaftlernaustausches/-aufenthaltes (PD Dr. Marlene Müller, Prof. Dr. Susanne Kruse) vom 1. April bis 16. April 2009 an der University of Cambridge und im Rahmen einer Vortragsreihe.
- Mitwirkende:** Mitarbeiter der Abteilung Finanzmathematik des Fraunhofer ITWM, Kaiserslautern
Professoren und Doktoranden des Statistical Laboratory der University of Cambridge (insbesondere der Arbeitsgruppe um Prof. L.C.G. Rogers), England
Prof. Dr. Susanne Kruse, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Prof. Dr. Holger Kraft, Goethe Universität Frankfurt
Prof. Dr. Ralf Korn, Universität Kaiserslautern

Firmenkundenbezogene potenzialorientierte Planung und Steuerung in Banken

- Ziel:** Pilotprojekt zur potenzialorientierten Planung des Firmenkundengeschäftes innerhalb der Sparkassen-Finanzgruppe, Untersuchungen zur Stabilität der Käuferprofile, Veröffentlichung der methodischen Grundkonzepte.
- Mitwirkende:** Prof. Dr. Wolfgang Barth, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Prof. Dr. Susanne Kruse, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
ifb AG; Sparkasse Steinfurt, Sparkasse Münsterland Ost, WLSGV
Consultingpartner AG

Privatkundenbezogene potenzialorientierte Planung und Steuerung in Banken

- Ziel:** Weiterentwicklung der potenzialorientierten Planung im Privatkundengeschäft der Sparkassen-Finanzgruppe, Untersuchungen zur Regionalisierung von Marktprognosen, Integration von Altersvorsorgeprodukten; Veröffentlichung der methodischen Grundkonzepte.
- Mitwirkende:** Prof. Dr. Wolfgang Barth, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Prof. Dr. Mark Trede, Westfälische Wilhelms-Universität Münster
WLSGV

Optimierungsmodelle für Call-Center-Einsatzplanungen bei Finanzdienstleistern

- Ziel:** Weiterentwicklung der Warteschlangentheorie für den Fall heterogener Anrufer- und Agentstrukturen.
- Mitwirkende:** Prof. Dr. Wolfgang Barth, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Dr. Michael Manitz, Universität zu Köln
Prof. Dr. Raik Stolletz, Technical University of Denmark, Lyngby/Copenhagen.

Risikothorie und Risikomanagement des privaten Haushalts

- Ziel: Entwicklung eines risikothoretischen Rahmenmodells mit einer Definition des haushaltsspezifischen Risikokontextes, einer Beschreibung des Risikoverhaltens privater Haushalte sowie der Ableitung einer Risikotypologie für private Haushalte. Entwicklung eines geschlossenes Risikomanagementsystems.
- Mitwirkende: Prof. Dr. Anne Böhm-Dries, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Prof. Dr. Eberhard Stickel, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Prof. Dr. Günter Schmidt, Hochschule Liechtenstein
VP-Bank Liechtenstein
- Drittmittel: Es wurden Mittel des Forschungsförderungsfonds der Hochschule Liechtenstein genehmigt, die am Studienort Liechtenstein eingesetzt werden.

Rechtsformspezifische Unterschiede von Finanzinstituten: Eine theoretische und empirische Analyse der deutschen Versicherungs- und Kreditwirtschaft

- Ziel: Stellt die Rechtsform eine wichtige Determinante für die Wirtschaftlichkeit eines Unternehmens dar? Diese Frage soll durch das Projekt für die deutsche Versicherungs- und Kreditwirtschaft beantwortet werden. Dazu werden zum einen die jeweils vorherrschenden Rechtsformen theoretisch hinsichtlich ihrer Vor- und Nachteile untersucht. Ausgehend von den unterschiedlichen Träger-/Eigentümerstrukturen und Organisationsformen wurden bisher unter anderem auf Basis der Prinzipal-Agenten-Theorie Hypothesen zum Verhalten der einzelnen Insti-tutsgruppen abgeleitet, die derzeit empirisch überprüft werden. Hierzu wird umfangreiches Datenmaterial zu Unternehmen der deutschen Versicherungs- und Kreditwirtschaft analysiert, um mit Hilfe statistischer Methoden tatsächlich beobachtbare Unterschiede zwischen den Rechtsformen herauszufinden.
- Mitwirkende: Prof. Dr. Claudia Breuer, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Prof. Dr. Wolfgang Breuer, RWTH Aachen
Dipl.-Kfm. Guido Hauten
Dipl.-Ing. Dipl.-Wirt. Ing. Alexandra Kaphahn
- Drittmittel: Projektförderung durch die Wissenschaftsförderung der Sparkassen-Finanz-gruppe e. V.

Private Equity als Geschäftsfeld von Sparkassen

- Ziel: Entwicklung einer Konzeption, wie Beteiligungskapital (Private Equity) als Geschäftsfeld von Sparkassen etabliert werden kann.
- Mitwirkende: Prof. Dr. Bernd Heitzer, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe

Umweltschutzrückstellungen in der Rechtsprechung des Bundesfinanzhofs

- Ziel: Kritische Analyse der Ansatzkriterien des Bundesfinanzhofs.
- Mitwirkende: Prof. Dr. Thomas Köster, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe

Bewertung amerikanischer Optionen unter Berücksichtigung von Dividendenzahlungen

Ziel: Herleitung einer geschlossenen Lösung zur Bewertung amerikanischer Optionen unter Berücksichtigung bekannter und unbekannter zukünftiger Dividendenzahlungen unter der Annahme, dass der Aktienkurs einer geometrischen Brownschen Bewegung folgt.

Projektpartner: Prof. Dr. Susanne Kruse, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
PD Dr. Marlene Müller, Abteilungsleiterin Finanzmathematik, Fraunhofer Institut für Techno- und Wirtschaftsmathematik, Kaiserslautern

Derivate in der internationalen Rechnungslegung

Ziel: Analyse der Abbildung gängiger Derivate (Plain-Vanilla-Optionen, Caps, Floors, Swaps) in der externen Rechnungslegung, insbesondere nach IFRS, und Weiterentwicklung dieser Betrachtungen für exotische Derivate.

Mitwirkende: Prof. Dr. Thomas Köster, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe
Prof. Dr. Susanne Kruse, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe

Strategien zur Effizienzsteigerung und Optimierung von Programmstrukturen

Ziel: Die Bachelor-Studiengänge der Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe zeichnen sich durch klare und konsistente Profile aus, erfüllen das Kriterium der „Berufsbefähigung“ in besonderer Weise und binden den Berufsalltag in das Studium ein. Sie definieren fachliche und methodische Kompetenzen über strategische Unternehmensentscheidungen, vermitteln Grundlagenwissen im Fach und mit ihren Schwerpunkten und lassen eine Spezialisierung auf konkrete Berufsfelder in der Kredit- und Versicherungswirtschaft zu. Sie integrieren Schlüsselqualifikationen für Studium, Beruf und lebenslanges Lernen und nutzen konsequent die Instrumente des Bologna-Prozess.

Mitwirkende: Prof. Dr. Georg Andreas Schmidt, Hochschule der Sparkassen-Finanzgruppe