

Risikosteuerung

Messung und Steuerung von Adressenrisiken im Kunden- und Eigengeschäft für Ein- und Umsteiger

11. - 12.06.2024
in Karlsruhe

Adressenrisiko **Spreadrisiko**
Kunden- und Eigengeschäft
CVaR **Monte-Carlo-Simulation**
Szenarioanalyse **Bewertungsrisiko**

Seminarbeschreibung:

Mittlerweile sind Adressenrisikomodelle bei allen Institutsgruppen ein Standard. Den Modellen liegen z.T. mathematische Annahmen zugrunde, die den Zugang für Einsteiger und Umsteiger im Thema erheblich erschweren.

Ziel des Seminars ist es, die Grundideen der verschiedenen CVaR-Modelle aller Institutsgruppen und deren Ergebniskennzahlen zu vermitteln und zu motivieren. Die Referenten verfügen über langjährige Erfahrungen in der Begleitung der Institute bei der praktischen Anwendung der Modelle.

Betrachtet werden Analysen der Adressenrisiken (Ausfall- und Migrationsrisiken) im Kunden- und Eigengeschäft. Die Quantifizierung der Migrationsrisiken ist auch eine zentrale Anforderung an Adressenrisiken im Rahmen der neuen ICAAP-Sichten.

Neben der Messung und Steuerung der Risikoart Adressenrisiko wird auch die Umsetzung in der ökonomischen und normativen Risikotragfähigkeitssicht praxisnah vermittelt.

Des Weiteren erfolgt ein praxisnaher Exkurs zu den Möglichkeiten des Einsatzes von Credit-Default-Swaps (CDS) und Credit-Linked-Notes (CLN) zur Steuerung von Adressenrisiken.

Wer sollte teilnehmen?

Einsteiger, Umsteiger und Führungskräfte aus den Bereichen Controlling, Treasury und Revision, die einen einfachen und transparenten Zugang zum Thema der Adressenrisikomessung und -steuerung erhalten wollen.

Hinweis zum Seminar:

Betrachtungen und Analysen im Seminar werden durch Spiele und Beispiele in Excel und mit Softwarekomponenten illustriert.

TERMIN:

11.-12. Juni 2024

ORT:

Eventfabrik, Karlsruhe

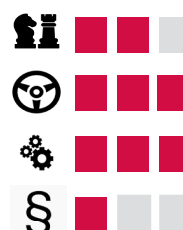
IHRE REFERENTEN:

Dr. Andreas Beck,
Andreas Jung

PREIS:

1.200,- EUR

SCHWERPUNKTE:



Risikosteuerung

Messung und Steuerung von Adressenrisiken im Kunden- und Eigengeschäft für Ein- und Umsteiger

Inhalt des Seminars:

Einführung

- Zielsetzung der Analysen und Abgrenzung zwischen Kunden- und Eigengeschäftsportfolien
- Abgrenzung der Modelltypen (Ausfall- und Migrationsmodelle)
- Aufsichtsrechtliche Anforderungen von Relevanz

Grundlagen der Funktionsweise zentraler CVaR-Messmodelle für Kunden- und Eigengeschäft

- Gemeinsame Umsetzung eines einfachen Portfoliomodells - die Monte-Carlo-Simulation spielerisch verstehen
- Das Modell CreditMetrics™
- Das Modell CreditPortfolioView™
- Gemeinsamkeiten und Unterschiede der Modelle
- Risikohorizont t_0 vs. t_1
- Zentrale Kennzahlen und Relevanz
- Praxisbeispiele
- Anforderungen an die Abbildung der Adressenrisiken durch die neuen ICAAP-Sichten ökonomisch und normativ

Parametrisierung der Modelle für das Kunden- und das Eigengeschäft

- Ausfall- und Migrationswahrscheinlichkeiten
- Rettungsquoten / Verlustquoten / Sicherheitenverwertungsquoten
- Zinskurven
- Credit Spread-Kurven
- Korrelationsparameter

Ausfall- und Migrationsrisiken in der ökonomischen Sicht

- Umgang mit ESG-Risiken und Beispielanalysen
- Risikokonzentrationsanalysen
- Integration der Ergebnisse für Kunden- und Eigengeschäft in die Risikotragfähigkeit mit Beispiel
- Nutzung von Diversifikation und Umgang in der Limitierung

Ausfall- und Migrationsrisiken in der integrierten Szenarioanalyse für die normative Sicht

- Adressenrisikomodelle multiperiodisch
- Adressenrisikomodelle in der Szenarioanalyse
- Integrierte Betrachtung mit Marktpreisrisikoszenarien
- Integrierte Betrachtung von Direktbestand und Fondsbestand
- Integration der Ergebnisse für Kunden- und Eigengeschäft in die Risikotragfähigkeit mit Beispiel

Zentrale Steuerungsinstrumente für Adressenrisiken:

- Kundengeschäft- und Eigengeschäftsportfoliosteuerung
- Bewertung und Risikomessung von CDS und CLN in der ökonomischen und normativen Sicht

Anmeldung

**www.icnova.de/veranstaltungen,
e-mail: sekretariat@icnova.de oder
Fax:+49 (0) 721 / 464 72 33 – 9**

Seminar / Datum _____

Institut _____

Straße _____

PLZ / Ort _____

Name / Vorname _____

Abteilung / Funktion _____

Telefon / Fax _____

E-Mail _____

Anmeldeunterlagen und Rechnung senden Sie bitte an:

Name / Vorname _____

Abteilung _____

Telefon / Fax _____

E-Mail _____

Zimmerreservierung bei Präsenzveranstaltungen:

Wir haben im Veranstaltungshotel Hotel Rebstock in Würzburg und GenoHotel Karlsruhe ein Zimmerkontingent zu Sonderkonditionen reserviert. Nähere Informationen dazu finden Sie auf Seite 8/9 in unserem Seminarkatalog oder unter www.icnova.de.

- Bitte senden Sie mir auch zukünftig Ihren Seminarkatalog.
- Ich möchte Ihren Newsletter/Kundenzeitschrift zu aktuellen Themen und Veranstaltungen erhalten.

Mit meiner Unterschrift willige ich ein, dass die von mir angegebenen Daten von der ICnova AG zum Zweck der Auftragsbearbeitung und Zusendung der oben ausgewählten Informationen gespeichert und genutzt werden dürfen. Eine Weitergabe an Dritte erfolgt nicht. Mir ist bekannt, dass ich meine Einwilligung jederzeit bei der ICnova AG, An der RaumFabrik 33c, 76227 Karlsruhe widerrufen kann.

Datum _____

Unterschrift _____