

Informationsveranstaltung

„Moderne Gesamtbanksteuerung für Banken und Sparkassen und Optimierung von Ertrag und Risiko im Kontext der Zinswende“
am 08.11.2022 in Frankfurt am Main

Die aktuelle Zinswende und damit verbundene Fragestellungen zur realistischen Parametrisierung der einzelnen Anlageklassen machen eine Überprüfung der aktuellen Kapitalallokation unverzichtbar. Von zentraler Bedeutung für die Institute ist darüber hinaus eine effektive und angemessene operative Risikomessung und -steuerung zur Abbildung der neuen ICAAP-Sichten im Herzstück der MaRisk, der Risikotragfähigkeit. Dabei sind die Synergien zwischen der Kapitalallokationsanalyse, den neuen ICAAP-Sichten und den Geschäftsmodellanalysen zu beachten.

Für die Vorstände und Entscheider in den Banken ist es von zentraler Bedeutung, eine hohe Transparenz über die Erfolgsquellen und Risikotreiber im Institut zu haben, um zu wissen, mit welchen Produkten, Vertriebsbereichen oder Vermögensanlagen die Ertragslage stabilisiert wird und wo die größten Risikoanfälligkeiten eines Hauses liegen.

Im Rahmen unserer Veranstaltungen informieren Sie unsere Experten über aktuelle Herausforderungen und Lösungswege.

Wir laden Sie recht herzlich zu unserer **kostenfreien Informationsveranstaltung** ein.

Die Veranstaltung beinhaltet aktuelle Entwicklungen und Lösungen in der Banksteuerung unter Berücksichtigung der derzeitigen aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu den Themen:

- Geschäftsmodell, Kapitalallokation und Strategien
- Planung und Reporting von Vertriebszielen im Kontext der Geschäftsmodellanalyse
- Aktuelle Fragestellungen zur Produktstrategie im Passivgeschäft
- Risikoinventur, Risikotragfähigkeit und Stresstests in den neuen ICAAP-Perspektiven (Ökonomische und Normative Sichtweise)
- Operative Risikosteuerung in beiden Sichtweisen des ICAAP (Zinsrisiko, Liquiditätsrisiko, Adressen- und Spreadrisiko, Integriertes Bewertungsrisiko)

Hierbei werden Lösungsvorschläge zur Umsetzung in der Praxis aufgezeigt und im Rahmen von Softwarerepräsentationen mit den Systemen

- ic.ICAAP
- ic.profit-view
- ic.risk-view
- ic.asset-allokation

dargestellt.

Informationsveranstaltung:

„Moderne Gesamtbanksteuerung für Banken und Sparkassen und Optimierung von Ertrag und Risiko im Kontext der Zinswende“

Agenda am 08. November 2022

9.15 – 9.45 Uhr

Kaffeempfang

9.45 – 10.00 Uhr

Begrüßung und Firmenvorstellung

(Dr. Michael Lesko, ICnova AG)

10.00 – 11.15 Uhr

Ertrag optimieren durch zielgerichtete Kapitalallokation mit ic.asset-allokation

(Dr. Andreas Beck, Dr. Michael Lesko, ICnova AG)

- Herausforderung Zinswende
- Prozess der Kapitalallokation
- Zentrale Nebenbedingungen RWA, LCR und SREP
- Strategische Bankplanung
- Praxisfall

Präsentation der Softwarelösung ic.asset-allokation

Aktuelle Fragestellungen zur Produktstrategie im Passivgeschäft

(Christoph Bleses, ICnova AG)

- Nachberechnung von Ratensparverträgen: Einzelvertragsanalysen und Batchverarbeitung für Sammelerstattungen und Rückstellungsberechnung
- Handlungsbedarf zur Produktstrategie im Passivgeschäft nach dem aktuellen Zinsanstieg im Spannungsfeld zwischen variablem Geschäft und Festzinsgeschäft
- Exkurs Geschäftsfelderfolgsrechnung: Planung, Messung und Steuerung der Erträge und Kosten im Vertrieb

Präsentation der Softwarelösung ic.profit-view

ic.profit-view ist das marktführende Analysetool zur Nachberechnung von Ratensparverträgen in der Einzelfallanalyse und der Gesamtbestandsanalyse im Rahmen der Batchverarbeitung (z.B. zur Quantifizierung der Rückstellungen) und bei ca. 200 Sparkassen und Genossenschaftsbanken im Einsatz.

12.30 – 13.30 Uhr

Mittagspause

13.30 – 14.30 Uhr

Zentrale Knackpunkte in der Umsetzung des neuen ICAAP und Verzahnung in die aktuellen Fragen der Banksteuerung

(Frank Blass, ICnova AG)

- Praxisbericht: Knackpunkte der ICAAP-Umsetzung
- Praxisumsetzung mit ic.ICAAP
- Verzahnung von ICAAP und aktuellen Fragen der Banksteuerung

Präsentation der Softwarelösung ic.ICAAP

Agenda am 08. November 2022

14.30 - 16.30 Uhr

Operative Risikomessung und Steuerung mit ic.risk-view in der Praxis (Dr. Andreas Beck, Martin Hesl, Andreas Jung, Dr. Michael Lesko, ICnova AG)

- Adressenrisiko
(Dr. Michael Lesko, ICnova AG)
 - Kunden- und Eigengeschäft
 - Ökonomische und normative Sicht
 - MaRisk-Abdeckung (Konzentrationsanalysen, ...)
 - Unterstützung der Parametrisierung und Validierung in ic.risk-view
- Markpreisisiko
(Andreas Jung, ICnova AG)
 - Ökonomische Sicht
 - Integrierte Messung von Marktpreisisiken
 - Normative Sicht
 - Integrierte Szenarioanalyse und Simulation von Metaszenerien (Zinsen, Spreads, Volatilitäten, Wechselkurse, ...) für unterschiedliche Geschäftstypen (diverse Anleihen, Swaps, CDS, Optionen...)
 - Exkurs: Abbildung von Basisrisiken
- Zinsrisiko
(Martin Hesl, Dr. Andreas Beck, Andreas Jung, ICnova AG)
 - Ökonomische Sicht
 - VaR-Modelle und Maßnahmenfindung
 - Risikomessung und ökonomische Zinsrisikosteuerung
 - Bafin-Koeffizient und SREP-Analysen
 - Normative Sicht
 - GuV-Simulation
 - Planszenario und adverse Szenarien
 - Implizite Optionen in der ökonomischen und in der normativen Sicht
 - Hedgekosten: Bewertung, Risikoanalyse und Maßnahmen
 - Wesentlichkeitsanalyse
- Liquiditätsrisiko
(Martin Hesl, ICnova AG)
 - ICAAP: Liquiditäts-VaR (LVaR)
 - ILAAP: Survival Period und Liquidity-at-Risk (LaR)

Präsentation der Softwarelösung ic.risk-view

Ausklang bei gemeinsamem Kaffee

ab 16.30 Uhr

Ihre Referenten:



Dr. Andreas Beck
ICnova AG



Frank Blass
ICnova AG



Christoph Bleses
ICnova AG



Martin Hesi
ICnova AG



Andreas Jung
ICnova AG



Dr. Michael Lesko
ICnova AG

Anmeldung:

ICnova AG
An der RaumFabrik 33c
76227 Karlsruhe

Fon:
+49 (0) 721 / 464 7233 - 0
Fax:
+49 (0) 721 / 464 7233 - 9

E-Mail: seminare@icnova.de
Internet: www.icnova.de

Veranstaltungsort:
Holiday Inn Frankfurt - Alte Oper
Mainzer Landstraße 27
60329 Frankfurt am Main

Tel. 0049(0)69 255 156 500
www.holidayinn.com

Per Fax an: +49 (0) 721 / 464 72 33 - 9
Per E-Mail an: seminare@icnova.de

Informationsveranstaltung

„Moderne Gesamtbanksteuerung für Banken und Sparkassen und Optimierung von Ertrag und Risiko im Kontext der Zinswende“ am 08.11.2022 in Frankfurt

- Die Veranstaltung ist kostenfrei -

Name, Vorname:

Abteilung:

Telefon, E-Mail:

Institut:

Straße:

PLZ, Ort:

Bitte beachten Sie: Verbindliche Anmeldung bis 31.10.2022

Datum, Unterschrift: