

Gesamtbanksteuerung

Gesamtbanksteuerung aus Sicht der Prüfung: Aufsichtsrechtliche Anforderungen und deren Umsetzung aus Revisionsicht

26. - 27.09.2024
in Karlsruhe

Risikokonzentrationen

Zinsrisiko

Risikotragfähigkeit (ICAAP)

SREP

ILAAP

MaRisk

Fonds

Seminarbeschreibung:

Das Aufgabengebiet der Prüfer und Revisoren hat sich in den vergangenen Jahren stark gewandelt. Standen in der Vergangenheit häufig formale Prüfungshandlungen im Fokus, so liegt der Schwerpunkt einer modernen Prüfungsstelle oder Revision heute auf einer qualitativen Beurteilung der Umsetzung aufsichtsrechtlicher Anforderungen. Damit wird die Prüfungsstelle oder der Revisor zum Berater des Vorstands oder der Fachbereiche und ist gefordert, sich detailliert und intensiv mit den fachlichen Fragestellungen der Banksteuerung auseinander zu setzen.

Das Seminar gibt übersichtlich aufbereitet und verständlich dargestellt einen fachlichen und methodischen Überblick zu den wesentlichen Inhalten einer modernen Gesamtbanksteuerung von den Implikationen der neuen Risikotragfähigkeit bis hin zu aktuellen Methoden der Risikomessung. Darauf aufbauend werden für die zentralen Prüfungsfelder Marktpreis-, Liquiditäts- und Adressenrisiken sowie Risikotragfähigkeit aktuelle Fragestellungen diskutiert. Häufig auftretende Fehler in der Praxis-Umsetzung der Steuerungsansätze werden besprochen und Lösungsansätze diskutiert.

Zielsetzung der Veranstaltung ist die zielgruppenorientierte Vermittlung des notwendigen Wissens zur Gesamtbanksteuerung sowie die Sensibilisierung für kritische Umsetzungsaspekte.

Wer sollte teilnehmen?

Fach- und Führungskräfte der Innenrevision, Mitarbeiter/innen von Prüfungsverbänden und Prüfungsgesellschaften.

TERMIN:

26. -27. September 2024

ORT:

Eventfabrik, Karlsruhe

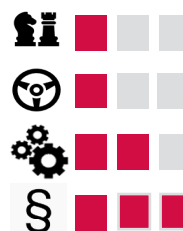
IHRE REFERENTEN:

Martin Feix,
Martin Hesl

PREIS:

1.200,- EUR

SCHWERPUNKTE:



Gesamtbanksteuerung

Gesamtbanksteuerung aus Sicht der Prüfung: Aufsichtsrechtliche Anforderungen und deren Umsetzung aus Revisionsicht

Inhalt des Seminars:

Aktuelle aufsichtsrechtliche Themen

- Aktuelle Weichenstellungen der Bankenaufsicht (u.a. Geschäftsmodellanalysen)
- Einordnung der aktuellen Entwicklungen in der Bankenaufsicht (LSI-SREP/ICAAP neu/ Nationale Rundschreiben)
- MaRisk als Herzstück der qualitativen Aufsicht

Erkenntnisse aus §44-Prüfungen

- Häufige Feststellungen
- Sinnvolle Behebung der Feststellungen

Überblick Gesamtbanksteuerung

- Themenfelder der Gesamtbanksteuerung
- Schwerpunkte der vertieften Betrachtung im Seminar

Prüfungsfeld "Marktpreisrisiken"

- Aktuelle aufsichtsrechtliche Anforderungen an das Zinsrisikomanagement (Rundschreiben 06/2019, SREP)
- Zentrales Prüfungsfeld "Variables Geschäft und Mischungsverhältnisse"
- Verlustfreie Bewertung des Bankbuches
- Exkurs: Basisrisiko
- Langlaufende Darlehen und weitere implizite Optionen
- Wertorientiertes Zinsrisikomanagement
 - Benchmarks und Limitierung
 - Wertorientierter Steuerungskreis
 - Aktuelle Methoden der Risikomessung (Moderne historische Simulation, Varianz-Kovarianz-Ansatz)
- Spreadrisiken
 - Methoden der Risikomessung
 - Einordnung der Risikowerte
- Sonstige Marktpreisrisiken und Risikomanagement
 - Risiken aus alternativen Investments (Immobilien, Infrastruktur, Private Equity,...)

Prüfungsfeld "Adressenrisiken (Kunden- und Eigengeschäft)"

- Kreditportfoliosteuerung Kundengeschäft

- Adressen- und Migrationsrisiken im Eigengeschäft

Prüfungsfeld "Liquiditätsrisiken"

- Zahlungsfähigkeitssicht
- Refinanzierungs(kosten)risiko
- Wesentliche Anforderungen ILAAP

Prüfungsfeld "Operationelle Risiken und sonstige Risiken"

- Risikomessung operationeller Risiken
- Ermittlung von Vertriebsrisiken
- Abbildung von Planabweichungsrisiken
- Berücksichtigung von Beteiligungsrisiken

Prüfungsfeld "Risikotragfähigkeit und Stresstests"

- Risikotragfähigkeit nach dem neuen Leitfaden (ICAAP)
 - Europäischer Rahmen
 - Neuer RTF-Leitfaden (Überblick)
 - Abgrenzung ICAAP und ILAAP
 - Ökonomische Perspektive - Grundidee der Umsetzung
 - Normative Perspektive - Grundidee der Umsetzung
 - Einordnung und Interpretation der Ergebnisse (insbes. der ökonomischen Perspektive)
- Risikoinventur und Risikokonzentrationen
 - Ökonomische und normative Perspektive
 - Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in die Risikoinventur
- Struktur und Umfang von Stresstests
- Validierung der verwendeten Modelle und Parameter
 - Zentrale vs. Dezentrale Validierung
 - Validierung vs. Modellrisiko

Prüfungsfeld "Geschäfts- und Risikostrategie"

- Konsistenz von Geschäfts- und Risikostrategie
- Fundierung der Strategien
- Geschäftsmodellanalysen und Strategien
- Wesentliche Steuerungskennzahlen und Handlungsimplicationen

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 _____