

Risikosteuerung

Messung von Marktpreis- und Liquiditätsspreadrisiken mit Varianten des Varianz-Kovarianz-Modells

16.04.2024
in Karlsruhe
und
01.10.2024
Online-Seminar

Praxiseinsatz
Value-at-Risk mit Korrelationsmodell
Varianz-Kovarianz-Ansatz
Ergebnisinterpretation **Steuerungsimpulse**

Seminarbeschreibung:

Ziel des Seminars ist die praxisnahe Vermittlung von methodischem Wissen zu Varianten des Varianz-Kovarianz-Ansatzes, der auf das Value-at-Risk-Modell RiskMetrics der RiskMetricsGroup bzw. von J.P. Morgan zurückgeht.

Betrachtet werden die Funktionsweise des Modells, die Parametrisierung und die Modellergebnisse sowie Grenzen und Risiken des Modells. Ein besonderes Augenmerk liegt auf der Interpretation und Plausibilisierung der Ergebnisse im bankpraktischen Einsatz im Rahmen der ökonomischen Risikotragfähigkeit.

Für die Anwendung der Marktpreisrisikomessung erfolgen Beispielbetrachtungen für die Risikoarten Zinsrisiko, Spreadrisiko und weitere Marktpreisrisiken (z. B. Aktienrisiken). Zudem wird auch ein praxisbezogener Beispielfall zur Liquiditätsrisikomessung für die ökonomische Risikotragfähigkeit dargestellt.

Die in der Banksteuerung eng mit der ökonomischen Risikotragfähigkeit verzahnte Fragestellung der Kapitalallokation wird thematisch ebenfalls mit betrachtet.

Wer sollte teilnehmen?

Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Risikocontrolling und Controlling mit Verantwortlichkeit im Thema Marktpreisrisiko sowie Mitarbeiter aus weiteren Bereichen (z. B. Treasury) mit Interesse an den Methoden und Wirkungsweisen von Varianz-Kovarianz-Ansätzen zur Risikomessung.

Hinweis zum Seminar:

Ausgewählte Excelbeispiele zum Wissenstransfer für Praktiker werden bereitgestellt.

TERMIN:

16. April 2024
01. Oktober 2024

ORT:

Eventfabrik, Karlsruhe
Online-Seminar

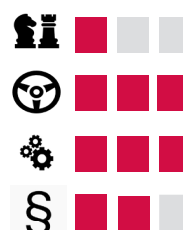
IHRE REFERENTEN:

Martin Feix,
David Klein

PREIS:

900,- EUR (Karlsruhe)
600,- EUR (Online)

SCHWERPUNKTE:



Risikosteuerung

Messung von Marktpreis- und Liquiditätsspreadrisiken mit Varianten des Varianz-Kovarianz-Modells

Inhalt des Seminars:

Einordnung des Modells in der Banksteuerung

- Sichtweisen in der Banksteuerung
- Risikomodelle und Stresstesting in der Bankenpraxis

Methodik des Modells

- Varianten der Delta-Normal-Methode
- Delta-Gamma-Methode
- Cornish-Fisher-Approximation
- Quantil-Approximation der Standardabweichung
- Nachvollziehbare Excelbeispiele für Praktiker zum Wissenstransfer

Parametrisierung des Modells

- Standardabweichung und VaR-Parameter
- Korrelations- und Kovarianzmatrix
- Cornish-Fisher-Approximation
- Beachtenswerte Aspekte im Praxiseinsatz: Frequenz der Daten (Tag, Monat), Historienlänge
- Nachvollziehbare Excelbeispiele für Praktiker zum Wissenstransfer

Anwendungsfälle

- Risikomessung der ökonomischen Risikotragfähigkeit
 - Liquiditätsspreadrisiko
 - Marktpreisrisikoportfolio
- Steuerungsaspekte
- Praxistipps
- Interpretation der Ergebnisse

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 _____