

Gesamtbanksteuerung

Stresstests und Risikokonzentrationen

13. -14.06.2024
Online-Seminar

Inverse Stresstests

Beurteilung von Stresstestergebnissen

Ausführliche Praxisbeispiele

Ertrags- und Risikokonzentrationen

MaRisk-Anforderungen

Seminarbeschreibung:

Die Durchführung von Stresstests ist eine zentrale Herausforderung für alle Finanzinstitute. Stresstests liefern eine wertvolle Ergänzung zur "Normal-Case"-Steuerung der Bank.

Im Rahmen dieses Seminars werden die aktuellen aufsichtsrechtlichen Anforderungen (MaRisk, EBA, ...) und deren Interpretation sowie lösungsorientierte Ansätze zur Umsetzung der Stresstests in der Praxis aufgezeigt.

Die Identifikation von Risikokonzentrationen ist für Banken von zentraler Bedeutung. Diese sind in der Regel die Hauptursache für Schieflagen oder die Insolvenz eines Hauses.

Wer sollte teilnehmen?

Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Treasury, Risikocontrolling und Revision sowie Vorstandsmitglieder mit Interesse an Detailwissen.

Einstufung des Seminars:

TERMIN:

13. - 14. Juni 2024

ORT:

Online-Seminar

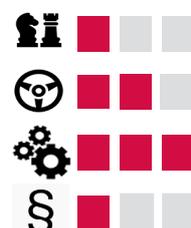
IHRE REFERENTEN:

Martin Feix,
David Klein

PREIS:

950,- EUR

SCHWERPUNKTE:



Gesamtbanksteuerung

Stresstests und Risikokonzentrationen

Inhalt des Seminars:

Überblick und Einführung

- Fragestellungen der Gesamtbanksteuerung
- ICAAP (ökonomische und normative Sicht)
- Risikoinventur und Stresstests
- Strategische Kapitalallokation
- Einordnung von Stresstests und Risikokonzentrationen

Aktuelle aufsichtsrechtliche Anforderungen an Stresstests und Risikokonzentrationen

- Anforderungen der MaRisk
 - Auslegungsfragen
 - Checkliste
- Weitere aufsichtsrechtliche Veröffentlichungen (EBA-Stresstests, ...)
- Ökonomischer vs. normativer Fokus

Betriebswirtschaftliche Grundlagen zu Stresstests

- Design
- Szenarien (empirische und hypothetische Ableitung)
- Sensitivitätsanalysen
- Inverse Stresstests
- Risikoartenübergreifende Analysen
- Quantifizierung im Rahmen von VaR-Methoden
- Quantifizierung mittels Szenarioanalysen
- Modellrisiken

Betriebswirtschaftliche Grundlagen zu Ertrags- und Risikokonzentrationen

- Zielgrößen
- Konzentrationsmaße
- Weitere Ansatzpunkte

Stresstests für Adressenrisiken im Kunden- und Eigengeschäft

- Ökonomischer vs. normativer Fokus
- Zentrale Risikofaktoren und Wirkungsweisen
- Parameterableitung und Datenquellen
- Analyse von Risikokonzentrationen
- Quantifizierung im Rahmen von VaR-Methoden
- Quantifizierung mittels Szenarioanalysen
- Praxisorientierte Fallbeispiele

Stresstests für Marktpreisrisiken inkl. Spreadrisiken

- Ökonomischer vs. normativer Fokus
- Zentrale Risikofaktoren und Wirkungsweisen
- Parameterableitung und Datenquellen
- Analyse von Risikokonzentrationen
- Quantifizierung
- Ergebniswerte
- Maßnahmen
- Praxisorientierte Fallbeispiele

Stresstests für Liquiditätsrisiken

- Ökonomischer vs. normativer Fokus
- Zentrale Risikofaktoren und Wirkungsweisen
- Parameterableitung und Datenquellen
- Analyse von Risikokonzentrationen
- Quantifizierung im Rahmen von VaR-Methoden
- Quantifizierung mittels Szenarioanalysen
- Praxisorientierte Fallbeispiele

Stresstests für operationelle Risiken

- Ökonomischer vs. normativer Fokus
- Zentrale Risikofaktoren und Wirkungsweisen
- Parameterableitung und Datenquellen
- Analyse von Risikokonzentrationen
- Quantifizierung im Rahmen von VaR-Methoden
- Quantifizierung mittels Szenarioanalysen
- Praxisorientierte Fallbeispiele

Risikoartenübergreifende Stresstests

- Ökonomischer vs. normativer Fokus
- "Stories"
- Aggregation von Risikoarten
- Quantifizierung im Rahmen von VaR-Methoden
- Quantifizierung mittels Szenarioanalysen
- Diversifikation in risikoartenübergreifende Stresstests und Sicherheitsaufschläge
- Praxisorientierte Fallbeispiele

Ergebnisse der Stresstests

- Beurteilung der Ergebnisse
- Mögliche Handlungsmaßnahmen
- Reporting

Exkurs: Validierung der Stresstests

- Aufsichtsrechtliche Anforderungen
- Qualitative und quantitative Validierung

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 _____