

Gesamtbanksteuerung

Umsetzung der neuen Risikotragfähigkeit/ICAAP nach den Anforderungen des neuen RTF-Leitfadens

23. -24.05.2022

in Karlsruhe

01. - 02.12.2022

in Würzburg

Umsetzungsempfehlungen
ICAAP und Risikotragfähigkeit

Ökonomische Perspektive

Normative Perspektive

Neuer RTF-Leitfaden

Seminarbeschreibung:

Der neue RTF-Leitfaden der nationalen Aufseher ("Aufsichtliche Beurteilung bankinterner Risikotragfähigkeitskonzepte und deren prozessualer Einbindung in die Gesamtbanksteuerung ("ICAAP") – Neuausrichtung") vom 24. Mai 2018 wird die Risikotragfähigkeitskonzeptionen grundlegend verändern. Auf Basis der MaRisk sollen die Risikotragfähigkeitsverfahren sowohl das Ziel der Fortführung des Instituts als auch den Schutz der Gläubiger vor Verlusten aus ökonomischer Sicht angemessen berücksichtigen. Vor diesem Hintergrund beinhalten die neuen Risikotragfähigkeitskonzeptionen eine normative Perspektive und eine ökonomische Perspektive.

Das Seminar vermittelt zunächst einen umfassenden Überblick über die neuen Anforderungen ausgehend vom europäischen Rahmen über die nationale Umsetzung. Im zweiten Teil werden fachliche Aspekte und spezielle Fragestellungen der Umsetzung der neuen Anforderung behandelt. Ein hoher Praxisbezug ist sichergestellt durch eine ausführliche Darstellung des Aufbaus der neuen Sichtweisen an einem durchgängigen Praxisfall einer Beispielbank.

Wer sollte teilnehmen?

Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Gesamtbanksteuerung, Risikocontrolling und Aufsichtsrecht.

TERMINE:

23. - 24. Mai 2022 (Karlsruhe)

01. - 02. Dezember 2022 (Würzburg)

ORT:

ICnova AG, Karlsruhe

Best Western Hotel Rebstock, Würzburg

IHRE REFERENTEN:

Frank Blass

Christoph Bleses

PREIS:

1.200,- EUR

Gesamtbanksteuerung

Umsetzung der neuen Risikotragfähigkeit/ICAAP nach den Anforderungen des neuen RTF-Leitfadens

Inhalt des Seminars:

Teil 1: Neue aufsichtsrechtliche Anforderungen an die Risikotragfähigkeit (ICAAP)

Mindestanforderungen an das Risikomanagement (MaRisk, 2021)

Europäischer Rahmen

Neuer RTF-Leitfaden (Überblick)

Teil 2: Zentrale Fragestellungen der zukünftigen Risikotragfähigkeit (ICAAP)

Überblick SREP

Abgrenzung ICAAP und ILAAP

Grundidee Umsetzung der ökonomischen Sichtweise

- Ermittlung des Deckungspotenzials
- Risikoquantifizierung (Risikomodelle vs. Szenarioanalyse)
- Risikoaggregation und Limitierung

Grundidee Umsetzung der normativen Sichtweise

- Mehrjährige Kapitalplanung
- Periodische Risikoquantifizierung und adverse Szenarien
- Spielräume bei der Szenarioableitung
- Auswirkungen und Zusammenhänge zu normativen Kennzahlen (z. B. RWA, Kapital)
- Verlustfreie Bewertung des Bankbuches
- Aspekte der Durchschau in Fonds

Integration von Risikoinventur und Stress-tests

- Verzahnung von ökonomischer und normativer Perspektive in der Risikoinventur
- Stresstests in der ökonomischen und normativen Perspektive

Teil 3: Praxisumsetzung

Umsetzung der ökonomischen und normativen Sichtweise

Darstellung anhand eines durchgängigen ausführlichen Praxisfalls (Beispielbank)

Teil 4: Auswirkungen des neuen ICAAP auf die Banksteuerung

Ökonomische Perspektive und Kapitalallokation

Wie kann ich die Schwankungen des ökonomischen RDP erklären (ex post-Analysen)?

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 ein Zimmerkontingent zu Sonderkonditionen reserviert. Dieses ist bis 6 Wochen vor Veranstaltungsbeginn unter dem Stichwort ICNOVA abrufbar. Nähere Informationen dazu finden Sie auf Seite 8 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 _____