

Informationsveranstaltung

Moderne Gesamtbanksteuerung für Banken und Sparkassen und
Optimierung von Ertrag und Risiko im Kontext der Zinswende
am 07.07.2023 in Karlsruhe

Der aktuelle Zinsanstieg und die damit verbundenen Chancen und Risiken machen eine Überprüfung der aktuellen Kapitalallokation unverzichtbar.

Speziell die regulatorischen und handelsbilanziellen Anforderungen wie SREP, BFA3 und der neue ICAAP führen zu Nebenbedingungen die stärker zu berücksichtigen sind.

Von zentraler Bedeutung für die Institute ist somit eine effiziente und angemessene operative Risikomessung und -steuerung.

Die derzeitigen Umschichtungen im Bereich der Kundeneinlagen stellen eine weitere Herausforderung dar.

Für die Vorstände und Entscheider in den Banken ist es essentiell, eine hohe Transparenz über die Erfolgsquellen und Risikotreiber im Institut zu haben, um zu wissen, mit welchen Produkten, Vertriebsbereichen oder Vermögensanlagen die Ertragslage stabilisiert werden kann.

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 informiert Sie über aktuelle Entwicklungen und Lösungen in der Banksteuerung unter Berücksichtigung der derzeitigen aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu den Themen:

- Geschäftsmodell, Kapitalallokation und Strategien
- 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 Softwarepräsentationen mit den Systemen

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

dargestellt.

Agenda am 07. Juli 2023

9:15 – 9:45 Uhr

Kaffeempfang

9:45 – 10:00 Uhr

Begrüßung und Firmenvorstellung

Dr. Michael Lesko (Vorstand ICnova AG)

10:00– 11:15 Uhr

Ertrag optimieren durch zielgerichtete Kapitalallokation mit **ic.asset-allokation**

Dr. Andreas Beck (ICnova AG)

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

Präsentation der **Softwarelösung ic.asset-allokation**

11.15 – 12:30 Uhr

Aktuelle Fragestellungen zur Produktstrategie im Passivgeschäft

Dr. Andreas Beck, David Klein (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
- Spezielle Wechselwirkungen zwischen Umschichtungen und BFA3

Präsentation der Softwarelösung **ic.profit-view**

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

Martin Hesi, Dr. Michael Lesko (ICnova AG)

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

Präsentation der **Softwarelösung ic.ICAAP**

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

Agenda am 07. Juli 2023

14:30 – 16:30 Uhr

Operative Risikomessung und Steuerung mit ic.risk-view in der Praxis

Martin Hesel, Dr. Michael Lesko (ICnova AG)

- Adressenrisiko
 - o Kunden- und Eigengeschäft
 - Ökonomische und normative Sicht
 - MaRisk-Abdeckung (Konzentrationsanalysen, ...)
 - o Unterstützung der Parametrisierung und Validierung in ic.risk-view
- Marktpreisrisiko
 - o Ökonomische Sicht
 - Integrierte Messung der Marktpreisrisiken
 - o Normative Sicht
 - Integrierte Szenarioanalyse und Simulation von Metaszenerien (Zinsen, Spreads, Volatilitäten, Wechselkurse, ...) für unterschiedliche Geschäftstypen (diverse Anleihen, Swaps, CDS, Optionen, ...)
- Zinsrisiko
 - o Ökonomische Sicht
 - VaR-Modelle und Maßnahmenfindung
 - Risikomessung und ökonomische Zinsrisikosteuerung
 - Bafin-Koeffizient und SREP-Analysen
 - o Normative Sicht
 - GuV-Simulation
 - Planszenario und adverse Szenarien
 - o Implizite Optionen in der ökonomischen und in der normativen Sicht
 - Hedgekosten: Bewertung, Risikoanalyse und Maßnahmen
 - Wesentlichkeitsanalyse

Präsentation der **Softwarelösung ic.risk-view**

ab 16:30 Uhr

Ausklang bei gemeinsamem Kaffee

Ihre Referenten:



Dr. Andreas Beck
ICnova AG



Martin Hesi
ICnova AG



David Klein
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/gesamtbanksteuerung/kontakt

Veranstaltungsort:

**Geno-Hotel Karlsruhe
Am Rüppurer Schloß 40
76199 Karlsruhe**

www.genohotel-karlsruhe.de

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

Informationsveranstaltung

"Moderne Gesamtbanksteuerung für Banken und Sparkassen und Optimierung von Ertrag und Risiko im Kontext der Zinswende" am 07.07. 2023

- Die Veranstaltung ist kostenfrei -

Name, Vorname:

Abteilung:

Telefon, E-Mail:

Institut:

Straße:

PLZ, Ort:

Wir bitten um Anmeldung bis spätestens 30.Juni 2023

Datum, Unterschrift: