

AKADEMIE BANKCONTROLLING - ZERTIFIKATSKURS 2. TEIL: RISIKOMANAGEMENT

DATUM DER NÄCHSTEN VERANSTALTUNG

08.07.2019 bis 12.07.2019

ORT

Mauritzhof Hotel Münster

Eisenbahnstraße 17

48143 Münster

Deutschland

Phone General: +49.251.4172.0

Fax: +49.251.4172.99

REFERENT

Klaus Leusmann Franco Opitz Wilhelm Menninghaus Martin Knippschild

AGENDA

Die Seminartage beginnen um 09:00 Uhr und enden jeweils gegen 17:00 Uhr. Am Freitag endet der letzte Vortrag um 12:30 Uhr. Im Anschluss daran hält das Hotel ein Mittagessen bereit.

Kaffeepausen 10:30 Uhr und 15:00 Uhr (30 Minuten)

Gem. Mittagessen 12:30 Uhr (60 Minuten)

Etwaige Programmänderungen aus dringendem Anlass bleiben vorbehalten.

Montag, 8. Juli 2019 - 9:00 bis 10:30

Modernes, integriertes Risikomanagement als zentrales Element der Banksteuerung

Managementperspektive versus bankaufsichtliche Betrachtungsweisen | Risikomessung im VaR-Konzept | Allokation von Risikokapital ? Risikoadjustierte Steuerungsgrößen - "RORAC and friends" | Relevante Risikoarten und Entstehungsursachen

Montag, 8. Juli 2019 - 11:00 bis 12:30

Risikomanagement - Teil I: Identifikation, Messung und Aggregation

Identifikation | Messung | Überblick und Bewertung wesentlicher VaR-Methoden | Varianz-Kovarianz-Modell | Historische Simulation | Aggregation zum Gesamtbankrisiko | Abgleich und Parametrisierung der Risikomodelle | Bedeutung von Korrelationseffekten

Montag, 8. Juli 2019 - 13:30 bis 15:00

Risikomanagement - Teil II: Risikotragfähigkeit und -limitierung

Zusammensetzung der Risikodeckungsmassen | Abstimmung von Risikopotenzial und Risikodeckungsmassen | Funktion und Einsatz von Risikolimiten ? Grundprinzipien einer Ertrags-Risiko-Steuerung für die Gesamtbank

Praxisbeispiel

Zusammenfassung: Nutzen und Grenzen einer RTF-Konzeption für die Gesamtbank

Montag, 8. Juli 2019 - 15:30 bis 17:00

RTF im Zuge des Supervisory Review and Evaluation Process (SREP)

Aufsichtliche Einordnung | SREP-Framework und Kapitalrisiken | SREP-Kapitalbewertung und ICAAP

Ausblick: Risikomanagement im Umbruch

Sind Ungewissheiten messbar? | Kosequenzen von Modellrisiken | Betrachtung der Fragilität | multidimensionales Risikomanagement

Dienstag, 9. Juli 2019 - 9:00 bis 10:30

Anforderungen an eine integrierte Zinsrisikosteuerung

Vorgehen, Zielgrößen und Methoden im Überblick | Impulse aus Performance- und GuV-Perspektive | Aufsichtsrechtliche Anforderungen an die Steuerung von Zinsänderungsrisiken | Komponenten des Zinsänderungsrisikos im Überblick | Konzepte und Umsetzungsstand in der Praxis der Institute

Dienstag, 9. Juli 2019 - 11:00 bis 12:30

Durchgängige Fallstudie - Barwertige Steuerungsperspektive und Kernprozesse:

Teil I: Cashflowgenerierung und Parametrisierung im Zinsbuch

Vorgehen bei der Datengenerierung in der Praxis | Strukturanalyse und Bewertung von Cashflows | Abbildung variabler Produkte aus der Zinsrisikoperspektive | Bedeutung impliziter Optionen im Kundengeschäft | Barwertermittlung für den Zinsbuchcashflow und ausgewählte Portfolios

Teil II: Performancerechnung und Ergebnissimulation für das Zinsbuch

Messung der Ergebnisse aus der Fristentransformations- und Zinsbuchsteuerung | Vorgehen bei der barwertigen Performancerechnung | Bedeutung von Zinsprognosen und Forward Rates für die Steuerung | Simulationen und Ergebnisentwicklungen für alternative Zinsszenarien im Praxisfall

Dienstag, 9. Juli 2019 - 13:30 bis 15:00

Teil III: Ausgestaltung des VaR-Risikomodells/Bedeutung der Anforderungen aus dem Basel-II-Zinsschock für die Steuerung des Zinsbuchs

Überblick der Modelle zur Zinsrisikoquantifizierung | Ausgestaltung der historischen Simulation | Bedeutung von Veränderungen in Risikoparametern für die Interpretation des Value at Risk | Vertiefung: Zinsschockregelung nach Basel II - Umgang mit dem Zinsschock in der Praxis und Bedeutung des übergreifenden "Prüfkriteriums" für die Risikosteuerung

Dienstag, 9. Juli 2019 - 15:30 bis 17:00

Teil IV: Umsetzung Risk-Return-Steuerung/Ausgestaltung des Reportings

Vernetzung Performance- und Risikosicht in Risk-Return-Kennziffern | Aufbau und Interpretation von Risk-Return-Diagrammen (Bedeutung RORAC-Kennziffer) | Bewertung der Ergebnisse im Vergleich zu alternativen Benchmarks | Beispiele zur Ausgestaltung des Reportings für die Zinsbuchsteuerung

Diskussion von Praxisanforderungen an die barwertige Steuerung des Zinsbuchs

Mittwoch, 10. Juli 2019 - 9:00 bis 10:30

Durchgängige Fallstudie - Periodische Steuerungsperspektive und Integration der Sichten:

Teil I: Einstieg und Überblick über die klassischen Konzepte

Steuerung mit Fristenablaufbilanz und Elastizitätsmodell | Ausgewählte Fallbeispiele zur Erläuterung der Konzepte | Bewertung und Anforderungen an die Weiterentwicklung der traditionellen Konzepte

Mittwoch, 10. Juli 2019 - 11:00 bis 12:30

Teil II: Periodische Ergebnissimulation und Zinsergebnisplanung

Eckpfeiler der Bilanzstruktur- und Zinsergebnisplanung - Überblick Prozess und Vorgehen | Notwendige Parametrisierungen im Kunden- und Eigengeschäft | Margen- und Neugeschäftsplanung | Identifikation der Ergebniswirkungen für die Erfolgsquellen des Zinsergebnisses

Mittwoch, 10. Juli 2019 - 13:30 bis 15:00

Teil III: GuV-Risiken und Potenziale aus Fristentransformation

Periodische Steuerung der "Erfolgsquelle Fristentransformation" | Bestimmung des "optimalen" Zinsbuchhebels im Rahmen der Fallstudie | Transformationsbeiträge als Hedge für das Geschäftsmodell | Ausgestaltung von aktiven versus passiven Steuerungsstrategien | Konsequenzen für die Steuerung des Zinsbuchs und die Planung von Maßnahmen

Mittwoch, 10. Juli 2019 - 15:30 bis 17:00

Überblick über die Messung und Steuerung von Liquiditätsrisiken

Strukturelles und kurzfristiges Liquiditätsrisiko ? Liquiditätsablaufbilanz (LAB) | Liquiditätsdeckungspotenzial (LDP) | VaR-konforme Messmethode | Bedeutung von LCR und NSFR als regulatorische Kennzahlen | Steuerungsanforderungen im Liquiditätsmanagement: Was ist die "Pflicht" - was ist die "Kür"?

Donnerstag, 11. Juli 2019 - 9:00 bis 12:30

Bewertung von Bonitäts- und Ausfallrisiken im Kreditgeschäft/Steuerung des Kreditportfoliorisikos

anhand des VaR-Konzepts mit Steuerungssystemen wie z. B. Credit Portfolio View (CPV)

Grundsätze der Quantifizierung von Bonitäts- und Ausfallrisiken im Kreditgeschäft | Portfolioorientierte

Kreditrisikosteuerung | Quantifizierung von Kreditportfoliorisiken am Beispiel von CreditMetricsTM und CreditRisk+TM |

Diversifikationsstrategien und Credit Treasury zur Portfoliosteuerung

Donnerstag, 11. Juli 2019 - 13:30 bis 15:00

Messung und Steuerung von operationellen Risiken

Abgrenzung operationeller Risiken | Identifikation | Bewertung | Steuerung | Reporting | Eigenkapitalanforderungen |

Integration in Gesamtbanksteuerung

Donnerstag, 11. Juli 2019 - 15:30 bis 17:00

Messung und Steuerung sonstiger Risiken und Ausgestaltung des Reportings

Reputationsbegriff | Messung und Steuerung von Reputationsrisiken | Messung und Steuerung strategischer Risiken |

Ausgestaltung und Umsetzung eines Gesamtbank-Risikoreportings

Freitag, 12. Juli 2019 - 9:00 bis 12:30

Moderne Verfahren zur Risikomessung und -steuerung in der bankbetrieblichen Praxis - Anwendungsbereiche und Grenzen

Praxisvortrag aus der DZ Bank