



**WISSEN  
MACHT  
ERFOLG**

# Marktrisiko in Banken - Tag 2

für Fortgeschrittene & Praktiker

Seminar-ID: 20309

Kursinfo: **EXPERTE**

Veranstaltungsformat: Seminar

---

## Das nehmen Sie mit

Sichern Sie sich umfassendes Know-how über die neuen aufsichtsrechtlichen Aspekte, um eine optimale interne Umsetzung zu gewährleisten und nutzen Sie die Gelegenheit und holen Sie sich bei unseren Experten einen Überblick über die aktuellen Entwicklungen im Meldewesen.

Profitieren Sie von einer umfassenden Einführung in die Themen Marktrisikomanagement, Value at Risk, Finanzmathematik sowie Risikokennzahlen und erfahren Sie mehr zu den Änderungen durch Basel IV (CRD V/CRR II). Zusätzlich wird ein Ausblick auf die regulatorischen Entwicklungen gegeben (Entwurf CRD VI / CRR III)

Sie erfahren zudem, welche Änderungen dieser „Fundamental Review of the Trading Book“ bringt und gewinnen Sie einen Einblick in den neuen Standardansatz und die Änderung bei internen Modellen.

## Ihr Programm im Überblick

Tag 2 – für Fortgeschrittene & Praktiker: G. Seiner, MBA

- Value at Risk
  - Marktrisikofaktoren
  - Returns, Verteilungen, Volatilität, Korrelationen
  - VaR Modelle
  - Bewilligungsverfahren für interne Modelle
  - Backtesting | Stresstesting
  - Expected Shortfall
  - Aktuelle regulatorische Entwicklungen
- Eigenmittelunterlegung Standardansatz
  - Rechtliche Rahmenbedingungen
  - Meldewesen, Ausweisrichtlinien
  - Eigenmittelerfordernis
  - Allgemeines und spezifisches Positionsrisiko
  - Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko
  - Standardansatz NEU (FRTB-SA)
  - Sensitivity Based Approach
  - Trading Desks

## Interessant für

Mitarbeiter von Kreditinstituten aus den Bereichen

- Recht
- Meldewesen

- Risikomanagement
- Special Service Desk
- Interne Revision
- Wirtschaftsprüfer
- Rechnungswesen
- Beratende Berufe
- EDV-Mitarbeiter
- Trainees

## Referent\*in



**Gerald Seiner MBA**

Spezialisiert auf Marktrisiko in Banken

## Termine & Optionen

DATUM	DAUER	ORT	FORMAT	PREIS
04.09.2024	0.5 Tage	Virtual Classroom	Online	€ 470,-
04.09.2024	0.5 Tage	Wien	Präsenz	€ 470,-
29.04.2025	0.5 Tage	Virtual Classroom	Online	€ 470,-
29.04.2025	0.5 Tage	Wien	Präsenz	€ 470,-
18.11.2025	0.5 Tage	Virtual Classroom	Online	€ 470,-
18.11.2025	0.5 Tage	Wien	Präsenz	€ 470,-

## Beratung & Buchung



**Jeffrey Müller-Büchse**

+43 1 713 80 24-38 ✉ [jeffrey.mueller-buechse@ars.at](mailto:jeffrey.mueller-buechse@ars.at)