



**WISSEN
MACHT
ERFOLG**

Marktrisiko in Banken

Grundlagen & Vertiefung zum
Marktrisikomanagement

Kursinfo: **BEGINNER** **EXPERTE**

Seminar-ID: 20307

CPE: 11,5 Punkte

Ort: Wien, Online

🔔 Darum lohnt sich der Kurs

Ein effizientes Marktrisikomanagement ist entscheidend, um Verluste durch Marktschwankungen zu minimieren. Machen Sie sich mit den Marktrisiken in Banken vertraut und erfahren Sie, wie spezielle Analysetools (Value-at-Risk) und Überprüfungen helfen, Risiken frühzeitig zu erkennen. An 2 Tagen bieten wir Ihnen ein umfassendes Wissen zum Marktrisikomanagement in Banken.

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 1 – für Einsteiger: DDr. Eckhardt, MBA, LL.M., MSc, G. Seiner

- Einführung in das Marktrisikomanagement
 - Rechtliche Rahmenbedingungen
 - Struktur der neuen europäischen Aufsicht
 - Single Rule Book
 - ICAAP - Internal Capital Adequacy Assessment Process
 - SREP - Supervisory Review and Evaluation Process
- Zinsänderungsrisiko im Bankbuch
 - Hauptformen des IRRBB
 - Zinsrisiko im Bankbuch / Säule II
 - Risikomessmethoden im Bankbuch
 - Zinsrisikostatistik | Europäische Entwicklungen
 - EBA Guideline IRRBB
- Von Basel III zu Basel IV (CRD VI / CRR III)
 - Value at Risk (VaR), stressed Value at Risk (sVaR)

- Incremental Risk Charge (IRC)
- Counterparty Credit Risk (CCR)
- Standardansatz SA-CCR
- Central Counterparty Clearing (CCP)
- Risikoanalyse
 - Risikoarten im Marktrisiko
 - Risikoanalyse im FX Bereich | Risikoanalyse im Zinsbereich
 - Preisermittlung von Anleihen
 - Risikokennzahlen Modified Duration, PVBP
 - Risikoanalyse im Aktienbereich
 - Optionen | Risikolimitierung

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



DDr. Jürgen Eckhardt MBA, LL.M., MSc

Experte im aufsichtsrechtlichen Meldewesen

Termine & Optionen

DATUM	DAUER	ORT	FORMAT	PREIS
28.04.2025-29.04.2025	1.5 Tag	Virtual Classroom	Online	€ 1.100,-
28.04.2025-29.04.2025	1.5 Tag	Wien	Präsenz	€ 1.100,-
17.11.2025-18.11.2025	1.5 Tag	Virtual Classroom	Online	€ 1.100,-
17.11.2025-18.11.2025	1.5 Tag	Wien	Präsenz	€ 1.100,-
13.10.2026-14.10.2026	1.5 Tag	Virtual Classroom	Online	€ 1.100,-
13.10.2026-14.10.2026	1.5 Tag		Präsenz	€ 1.100,-

Preise exkl. MwSt.

Beratung & Buchung



Jeffrey Müller-Büchse

☎ +43 1 713 80 24-38 ✉ bildungsmanagement@ars.at