



**WISSEN
MACHT
ERFOLG**

Marktrisiko in Banken - Tag 1

für Einsteiger

Kursinfo: **BEGINNER**

Seminar-ID: 20308

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).

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

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



DDr. Jürgen Eckhardt MBA, LL.M., MSc
Experte im aufsichtsrechtlichen Meldewesen



Gerald Seiner MBA
Spezialisiert auf Marktrisiko in Banken

Termine & Optionen

DATUM	DAUER	ORT	FORMAT	PREIS
28.04.2025	1 Tag	Virtual Classroom	Online	€ 660,-
28.04.2025	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 660,-
17.11.2025	1 Tag	Virtual Classroom	Online	€ 660,-
17.11.2025	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 660,-

Beratung & Buchung



Jeffrey Müller-Büchse
☎ +43 1 713 80 24-38 ✉ jeffrey.mueller-buechse@ars.at