



**WISSEN
MACHT
ERFOLG**

Marktrisiko in Banken – Grundlagen

Einführung in das
Marktrisikomanagement &
Zinsänderungsrisiko

Kursinfo: **BEGINNER**

Seminar-ID: 20308

Ort: Wien, Online

🔔 Darum lohnt sich der Kurs

Das Marktrisikomanagement trägt dazu bei, die Stabilität und Rentabilität von Banken und Finanzinstituten zu sichern. Machen Sie sich aktuellen Marktrisiken vertraut und erfahren Sie im Kurs, wie Sie das Zinsänderungsrisiko im Bankbuch erfolgreich messen und steuern. Verschaffen Sie sich einen grundlegenden Überblick über die Markt- & Zinsänderungsrisiken in Banken.

Das nehmen Sie mit

Finanzmärkte sind von Natur aus volatil. In Zeiten wirtschaftlicher Unsicherheit oder wechselnder Zinssätze können Banken und Finanzinstitute signifikante Risiken durch **Markt- und Zinsänderungen** erfahren. Ein umfassendes **Verständnis der Marktrisiken** und die richtige Steuerung dieser Risiken sind entscheidend, um die **langfristige Stabilität von Banken** zu gewährleisten.

Machen Sie sich im Kurs mit den **Markt- & Zinsänderungsrisiken** vertraut: **IRRBB (Interest Rate Risk in the Banking Book) & CSRBB (Credit Spread Risk in the Banking Book)**. Die effektive Überwachung und Steuerung **Marktrisiken im Bankbuch (IRRBB & CSRBB)** sind unerlässlich, um die Stabilität und Rentabilität von Banken zu sichern.

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,-
13.10.2026	1 Tag	Virtual Classroom	Online	€ 660,-
13.10.2026	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 660,-

Preise exkl. MwSt.

Beratung & Buchung



Jeffrey Müller-Büchse

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