ARS Akademie

WISSEN MACHT ERFOLG

Marktrisiko in Banken – Vertiefung

Überwachung von Marktrisikofaktoren durch Value at Risk (VaR)

Kursinfos

Jetzt online buchen!

Kursinfo: EXPERTE

Seminar-ID: 20309

Ort: **Wien, Online**

📢 Darum lohnt sich der Kurs

Vertiefen Sie im Kurs Ihr Wissen zum Marktrisiko in Banken. Erfahren Sie, wie Sie VaR Modelle effizient anwenden und anpassen, um das Marktrisiko präzise zu messen. Wir zeigen Ihnen, wie Sie mit Backtests die Modellgenauigkeit überprüfen und mit Stresstests extreme Szenarien simulieren.

Das nehmen Sie mit

Märkte sind in ständiger Bewegung, und die finanziellen Risiken, die Banken betreffen, ändern sich entsprechend. Das Marktrisiko umfasst potenzielle Verluste, die durch Schwankungen von Marktpreisen, wie Zinsen, Wechselkurse und Aktienkurse, entstehen können. Ein häufig verwendetes Instrument zur Messung des Marktrisikos ist der **Value at Risk (VaR)**, der den maximalen Verlust eines Portfolios innerhalb eines bestimmten Zeitraums und bei einem festgelegten Konfidenzniveau schätzt. Um die Belastbarkeit eines Portfolios unter extremen Marktentwicklungen zu testen, sind **Backtests** und **Stresstests** unerlässlich. Diese Methoden helfen, die Genauigkeit von Risikoabschätzungen zu überprüfen und die Fähigkeit des Portfolios zu bewerten, in unvorhergesehenen Marktsituationen standzuhalten.

Vertiefen Sie im Kurs „Marktrisiko in Banken“ Ihr Verständnis für die aktuellen Marktrisikofaktoren und erfahren Sie, worauf Sie bei der Durchführung und Interpretation von Backtests und Stresstests achten müssen. Holen Sie sich Tipps zur Überwachung von Marktrisikofaktoren durch Value at Risk (VaR).

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
18.11.2025	0.5 Tage	Virtual Classroom	Online	€ 510,-
18.11.2025	0.5 Tage	Wien	Präsenz	€ 510,-
14.10.2026	0.5 Tage	Virtual Classroom	Online	€ 510,-
14.10.2026	0.5 Tage	Wien	Präsenz	€ 510,-

Preise exkl. MwSt.

Beratung & Buchung

Jeffrey Müller-Büchse
+43 1 713 80 24-38 bildungsmanagement@ars.at