



*Wissen, das beflügelt.*

# Szenarioanalysen & Stresstesting Essentials

Aufbau, Grundlagen &  
regulatorische Orientierung

## 🔑 Darum lohnt sich der Kurs

Szenarioanalysen und Stresstests liefern die Grundlage für fundierte Risikoentscheidungen und regulatorische Steuerung. Unterschiedliche Szenariotypen, steigende Aufsichtserwartungen und neue Risikotreiber stellen Banken vor neue Herausforderungen im Umgang mit ICAAP und Risikoberichterstattung.

## Das nehmen Sie mit

Szenarioanalysen und Stresstests zählen zu den wichtigsten Instrumenten der Risikosteuerung im Bankensektor. Regulatorische Erwartungen von **EBA, EZB und FMA** sowie steigende Anforderungen an Transparenz und Prognosefähigkeit erhöhen die Bedeutung dieser Methoden für ICAAP und Risikoberichterstattung.

Ein fundiertes Verständnis der unterschiedlichen **Szenariotypen**, von makroökonomischen bis hin zu institutsindividuellen Ansätzen, bildet die Grundlage für deren Anwendung. Gleichzeitig zeigt sich, wie Modelle und Annahmen die Aussagekraft von Stresstests beeinflussen und welche Rolle sie in Governance und Entscheidungsprozessen spielen.

Aktuelle Entwicklungen wie **Klimarisiken, neue Risikotreiber und der Einsatz moderner Technologien** erweitern den Blick auf Stresstesting und Szenarioanalysen. Praxisbeispiele und Erkenntnisse aus Prüfungen unterstützen dabei, Ergebnisse richtig einzuordnen und in der Bankpraxis nutzbar zu machen.

## Ihr Programm im Überblick

Grundlagen: Was sind Szenarioanalysen & Stresstests?

Regulatorische Anforderungen und Erwartungen der Aufsicht

- Sie verstehen regulatorische Erwartungen und wissen, welche Rolle Stresstests im aufsichtsrechtlichen Rahmen spielen.

Unterschiede zwischen makroökonomischen und institutsindividuellen Szenarien

Überblick über typische Modelle und Anwendungsfälle in der Bankpraxis

- Sie können Stresstestergebnisse interpretieren und deren Bedeutung für Governance und Steuerung einschätzen.

Einblicke in Klima- und Umweltrisiken sowie neue Risikotreiber

Kurzinput: Rolle neuer Technologien & Advanced Analytics

- Sie erhalten ein grundlegendes Verständnis über Technologien und neue Methoden, die Szenarien & Stresstests unterstützen.

Praxisbeispiele & Lessons Learned aus aktuellen Prüfungen

## Interessant für

- Vorstand & Aufsichtsrat

- Risikomanager\*innen und Stresstest-Verantwortliche
- Mitarbeiter\*innen aus ICAAP/ILAAP, Gesamtbanksteuerung und Risikocontrolling
- Expert\*innen aus Data Analytics
- Führungskräfte aus Regulatory Reporting, Compliance und Aufsichtskommunikation

## Referent\*in



**Ina Dimitrieva**

Expertin für Risikomanagement & ESG

## Termine & Optionen

DATUM	DAUER	ORT	FORMAT	PREIS
13.11.2026	2.5 Stunden	Virtual Classroom	Online	€ 450,-

Preise exkl. MwSt.

## Beratung & Buchung



**Jeffrey Müller-Büchse**

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