

# Marktrisiko in Banken

CRR III / Basel IV uvm.

---

Seminar-ID: **20307**

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

CPE: **11,5 Punkte**

Veranstaltungsformat: **Seminar**

---

## 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

---

Sie haben Fragen? ☎ +43 1 713 80 24-0 ✉ [office@ars.at](mailto:office@ars.at) 📍 Schallautzerstraße 4, 1010 Wien

- Risikoanalyse
  - Risikoarten im Marktrisiko
  - Risikoanalyse im FX Bereich | Risikoanalyse im Zinsbereich
  - Preisermittlung von Anleihen
  - Risikokennzahlen Modified Duration, PVBP
  - Risikoanalyse im Aktienbereich
  - Optionen | Risikolimitierung
- 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 V / CRR II)
  - Value at Risk (VaR), stressed Value at Risk (sVaR)
  - Incremental Risk Charge (IRC)
  - Counterparty Credit Risk (CCR)
  - Standardansatz SA-CCR
  - Central Counterparty Clearing (CCP)

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

## Enthaltene Module

- Marktrisiko in Banken - Tag 1
- Marktrisiko in Banken - Tag 2

## 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

**Sie haben Fragen?**  **+43 1 713 80 24-0**  **office@ars.at**  **Schallautzerstraße 4, 1010 Wien**

## Termine & Optionen

Datum	Dauer	Ort	Angebot	Preis
04.09.2023-05.09.2023	1.5 Tage		Präsenz	€ 880,-

Sie haben Fragen?  +43 1 713 80 24-0  [office@ars.at](mailto:office@ars.at)  Schallautzerstraße 4, 1010 Wien