

# Marktrisiko in Banken – Tag 1

für Einsteiger

---

Seminar-ID: **20308**

Kursinfo: **BEGINNER** **AKTUELL**

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).

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
- Risikoanalyse
  - Risikoarten im Marktrisiko

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

---

- 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)

## 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

## Termine & Optionen

Datum	Dauer	Ort	Angebot	Preis
24.01.2022	1 Tag		Online	€ 520,-

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