

Marktrisiko in Banken - Tag 2

für Fortgeschrittene & Praktiker

Seminar-ID: 20309

Kursinfo: **EXPERTE**

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 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

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

- 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

Termine & Optionen