

Webinare Risikomanagement

Themen, Agenden und Termine 2021

partners for change **zeb**

Risikomanagement

Vorwort und Zielgruppe



Das Eingehen von Risiken gehört zum Geschäftsmodell von Banken, soweit sie in ihrer Gesamtheit tragfähig sind und sich angemessen verzinsen bzw. rentieren.

Während eine angemessene Preisfestsetzung für Risikokomponenten bei der Konditionsgestaltung von Bankgeschäften Gegenstand der Module zur integrierten Banksteuerung ist, geht es bei den Modulen des **Risikomanagements** um die Sicherstellung der Risikotragfähigkeit von Finanzinstituten im Rahmen eines Managementkreislaufs aus Risikoidentifizierung, Risikomessung und Risikosteuerung sowie eine angemessene Risikorendite.

Risiken sind dabei definiert als in der Zukunft liegende, ungewisse Ereignisse mit negativen Auswirkungen auf das Vermögen bzw. die laufenden Ergebnisse.

Die besondere Herausforderung ihrer Quantifizierung liegt darin, dass Ungewissheiten per Definition nicht prognostizierbar sind und von daher die „Messung“ vereinfachende Annahmen erforderlich macht.

Die einzelnen Module sind unabhängig voneinander und grundsätzlich auch in beliebiger Reihenfolge buchbar. Wir empfehlen jedoch, sie in der angeführten Reihenfolge zu buchen, da sie inhaltlich aufeinander aufbauen.



Die Module der Seminarreihe **Risikomanagement** richten sich an alle Verantwortlichen für Risiken, das Senior Management, die Geschäftsleitung sowie an Mitarbeiter/innen aus den Bereichen Controlling, Risikocontrolling, Produktentwicklung und Orga/EDV.

Webinare Risikomanagement

Aktueller Hinweis zu COVID-19



Unsere Seminarteilnehmer und damit unsere Kunden stehen bei uns an erster Stelle, in diesen Tagen vor allem ihre Sicherheit und Gesundheit.

Aufgrund der aktuellen Situation und den behördlichen Anordnungen haben wir unser Seminarprogramm angepasst: Unsere klassischen Präsenz-Seminare der Seminarreihe **Risikomanagement** haben wir auf Online-Webinare umgestellt. Voraussichtlich werden wir ab dem 2. Halbjahr 2021 wieder Präsenzformate anbieten.

Einige Programmpunkte/Themen unserer Präsenz-Veranstaltungen wie z. B. Workshops zur Risikokultur sind virtuell leider nicht umsetzbar, so dass wir die Agenden der einzelnen Module entsprechend angepasst haben.

Die Inhalte und Termine der einzelnen Module entnehmen Sie bitte den folgenden Seiten.



Sollten Sie Fragen zu den Inhalten oder Abläufen der einzelnen Module haben, sprechen Sie uns gerne an:

Klaus Leusmann
Phone: 0251.97128.808
E.Mail: kleusmann@zeb.de



Webinare Risikomanagement

Modul 1 – Financial Risks

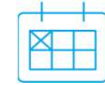


Dieses Webinar behandelt die banktypischen Adress-, Marktpreis- und Liquiditätsrisiken.

Nach den definitorischen Grundlagen und Abgrenzungen des ICAAP werden insbesondere die Adressrisiken, die Zinsänderungsrisiken des Bankbuchs (IRRBB) und die Liquiditätsrisiken in all ihren Facetten beleuchtet, einschließlich ihrer Quantifizierung in Form eines Value at Risk bzw. Liquidity at Risk. Es folgen die verschiedenen Methoden der aktiven und passiven Risikosteuerung.

Die Teilnehmer gewinnen in diesem Webinar einen detaillierten Überblick über diese Risiken, einschließlich „gemischter Positionen“ sowie die Methoden ihrer Steuerung.

Sie lernen dabei auch die Möglichkeiten und Grenzen von Risikomodellen kennen und verstehen die Notwendigkeit der eigenen betriebswirtschaftlichen Beurteilung.



2. – 4. März 2021

24. – 26. August 2021

Das Webinar wird als GotoMeeting-Konferenz, jeweils von 9:00 bis 17:00 Uhr, durchgeführt.

Die Webinar-Unterlagen werden, zusammen mit dem GotoMeeting-Termin, vor Webinar-Beginn an Sie verschickt.

Die Teilnahmegebühr beträgt 1.950,00 € zzgl. MwSt.

Webinare Risikomanagement

Modul 1 – Financial Risks



1. Webinar-Tag



- Grundlagen, Definitionen, Abgrenzungen ICAAP
- Einführung Adressrisikosteuerung, Einzelgeschäft, Risikoquantifizierung
- Grundlagen Portfoliorisiko inklusive Fallstudie, „State of the art“ Kreditportfoliomodellierung
- Periodische versus ökonomische Risikomessung, Fallstudie „Portfolioanalyse und Steuerungsimpulse“



2. Webinar-Tag



- Adressrisikosteuerung (Pricing, Limitierung, Verbriefungen, Derivate,...)
- Einführung IRRBB, barwertige und periodische Messung, Zinsergebnissimulation
- Grundlagen einer integrierten Steuerung, barwertige und periodische Steuerung, Strategieentwicklung
- Abgrenzung Zinsänderungs- und andere Marktpreisrisiken, Credit-Spreads in Marktdaten, Credit-Spread-Risiken



3. Webinar-Tag



- Sonstige Marktpreisrisiken, Aktienkursrisiken, Fondspreisrisiken, FX-Risiko
- Einführung Liquiditätsrisiken und ILAAP, strukturelles und kurzfristiges Risiko, regulatorische Überwachung
- Instrumente des Managements, Liquiditätsrisikostategie, ökonomische Risikoüberwachung
- Liquiditätskostenverrechnung, Notfallplanung, Liquiditätsrisikoreporting

Beginn: 9:00 Uhr, Ende: 17:00 Uhr, Pausen werden während des Webinars festgelegt.

Webinare Risikomanagement

Modul 2/3 – Non Financial Risks/Risk Management Framework

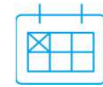


Finanzmarktkrise, Niedrigzinsphase, Digitalisierung und politische Risiken haben uns vor Augen geführt, dass gerade die so genannten „Non Financial Risks“ eine entscheidende Bedeutung für die Risikotragfähigkeit von Kreditinstituten haben.

Im Zentrum der Betrachtungen stehen neben den klassischen operationellen Risiken strategische Geschäftsmodellrisiken, kulturelle Risiken und das Cyber Risk. Ihre Messung ist insbesondere deshalb eine besondere Herausforderung, weil die für die klassischen Methoden erforderlichen Vergangenheitsdaten kaum bzw. unzureichend zur Verfügung

Die Teilnehmer lernen diese Risiken und ihre Bedeutung anhand aktueller Beispiele kennen, einschließlich der in weiten Teilen noch jungen Methoden ihrer Erfassung und Steuerung.

Neben einem Überblick über die Verzahnung von Risikomanagement und Gesamtbanksteuerung sowie den aufbau- und ablauforganisatorischen Anforderungen an das Risikomanagement wird das Thema der aufsichtlichen und internen Stresstests von dem Hintergrund ihrer zunehmenden Bedeutung beleuchtet.



20. – 22. April 2021

9. – 11. November 2021

Das Webinar wird als GotoMeeting-Konferenz, jeweils von 9:00 bis 17:00 Uhr, durchgeführt.

Die Webinar-Unterlagen werden, zusammen mit dem GotoMeeting-Termin, vor Webinar-Beginn an Sie verschickt.

Die Teilnahmegebühr beträgt 1.950,00 € zzgl. MwSt.

Webinare Risikomanagement

Modul 2/3 – Non Financial Risks/Risk Management Framework



1. Webinar-Tag



- Einführung Non Financial Risks (Übersicht, Charakteristika)
- Operationelle Risiken/Cyber Risk (Überblick, Messung/Management, Risikosteuerung, regulatorische Anforderungen)
- Strategische Risiken (Beispiele, Nachhaltigkeit, qualitative/quantitative Analyse)



2. Webinar-Tag



- Risikomanagement im Umbruch – neue Ansätze zur Vermeidung der Fehler klassischer Messverfahren
- Big Picture: Risikomanagement Framework
- Verzahnung Risikoappetit – Gesamtbanksteuerung, operative Limitierung
- Stresstest (aufsichtlich und intern)



3. Webinar-Tag



- Reporting inklusive aufsichtliche Anforderungen
- Aufbau-/Ablauforganisation (Benchmarking/Best Practice)
- Zusammenfassung/Ausblick

Beginn: 9:00 Uhr, Ende: 17:00 Uhr, Pausen werden während des Webinars festgelegt.