

Validierung sowie Backtesting verschiedener (periodischer) Zinsbuch-Stresstests und barwertiger Zinsrisikomodelle zur Verringerung von Modellrisiken!



# Umgang mit Modellrisiken: Zinsbuch-Stresstests & adverse Zinsszenarien

Modul 2: Modellunsicherheit durch unvollständige Datenhistorie • plausible Stress-/Szenario-Analysen zu Zinsstrukturkurven in Barwert- und GuV-Welt  
• neue MaRisk-Vorgaben

Mit diesem und weiteren Seminaren können Sie auch ein Zertifikat erwerben, alle Infos finden Sie hier: [Zertifizierter Spezialist Zinsrisikomanagement \(FCH\), SE2403022, 11.03.2024 - 14.03.2024](#)

- **Stresstests** und adverse Szenarien für **Zinsstrukturkurven** in der **Barwert-** und **GuV-Welt** – Ableitung von **Stresskurven** (z.B. aus einer historischen barwertigen VaR-Simulation oder Expertenschätzung) für die neue ökonomische und normative **Risikotragfähigkeit-Perspektive**
- Berücksichtigung **neuer MaRisk-Anforderungen** an u.a. **Stresstests** aus AT 4.3.3., Verwendung **von Modellen** aus AT 4.3.5. sowie **Zinsänderungs- und Credit-Spread-Risiken** des Anlagebuchs aus BTR 2.3
- Welche **Szenarioanalysen** und **Stresstests** kommen für **variable Produkte** und **Implizite Optionen** infrage? – Durchspielen von **Ausgleichszahlungen** und Annahmen zur **Zinsreagibilität** zur Abbildung von **Volumenschwankungen**
- **Modellrisiken** im Kontext **barwertiger Zinsbewertungsmethoden** in der neuen **ökonomischen** Perspektive
- **Geschäfts- und Bilanzstruktur-Szenarien** als wesentlicher Bestandteil der **periodischen** Zinsbuchsteuerung
- **Modellunsicherheit** als Gegenstand von Zinsrisiko-**Stresstests** (z.B. Länge des Risikobetrachtungshorizonts, Höhe des Konfidenzniveaus)
- **Inverse Stresstests** in Bezug auf **Zinsrisiken** – Rückwärtsschätzung aus eigener **Risikotragfähigkeit** heraus
- **Validierung** bzw. Backtesting der verschiedenen Zinsbuch-Stresstests und barwertiger Zinsrisikomodelle **zur Reduzierung** von **Modellrisiken**
- **Anlass(un)abhängige** Zinsbuch-Stresstests in Abhängigkeit von der **Portfoliostruktur** und **Risikosituation**
- **Impulse** aus Zinsbuch-**Stresstestergebnissen** für die Gesamtbanksteuerung: u.a. Unterstützung strategischer Entscheidungen in Bezug auf Depot A/**Asset Allokation** und Ausrichtung auf neue **Geschäftsmodelle**

14:00 - 17:00 Uhr

**Annika Eberwein**

Risikocontrollerin Controlling  
Kasseler Sparkasse

U.a. Durchführung von internen Risiko-, Szenario-Analysen und (adversen) Stresstests. Autorin von Fachpublikationen.

(dazwischen 15 min. Pause)

Durch die Teilnahme am Seminar erhalten Sie

**4 CPE-Punkte**

als Weiterbildungsnachweis für Ihre Zertifizierung

Mit freundlicher Unterstützung unseres namhaften und etablierten Kooperationspartners:



# Umgang mit Modellrisiken: Zinsbuch-Stresstests & adverse Zinsszenarien

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	339,15 €
Treue PLUS 20	319,20 €
Treue PLUS 25	299,25 €

Sie interessieren sich für unser TreuePlus-Rabattmodell?  
Infos unter <https://fch-gruppe.de/TreueAngebot>

Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen.

Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

Ich kann nicht am Seminar teilnehmen und bestelle deshalb die Seminarunterlagen als PDF zu den oben angekreuzten Seminaren   
(150,00 € \*\*\* je Semindokumentation)

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:  
(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Nach stark gestiegenen Zinsen befinden sich viele Banken auf der Suche nach geeigneten Annahmen, validen Risikoparametern und zuverlässigen Bewertungsdaten für die (barwertige) Zinsbuchsteuerung. Eine große Herausforderung stellen Zinsbuch-Stresstests und adverse Szenarien für Zinsstrukturkurven in der Barwert- und GuV-Welt dar; so z.B. die Ableitung plausibler Stresskurven – auf Basis einer historischen barwertigen VaR-Simulation oder Expertenschätzung – für die neuen Risikotragfähigkeit-Perspektiven. Dies erfordert u.a. Validierung bzw. Backtesting der verschiedenen Zinsbuch-Stresstests und barwertigen Zinsrisikomodelle zur Reduzierung von Modellrisiken unter Beachtung neuer MaRisk-Anforderungen (u.a. an Stresstests aus AT 4.3.3., Verwendung von Modellen aus AT 4.3.5., Zinsänderungs- und Credit-Spread-Risiken des Bankbuchs aus BTR 2.3).

12.03.2024 14:00 bis 17:00 Uhr

Der Zugang zum Seminar erfolgt über Ihren persönlichen Nutzerbereich in „MeinFCH“. Informationen zum Zugang und eine Anleitung erhalten Sie spätestens eine Woche vor dem Seminar. Ihre Teilnahmebestätigung und die Semindokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei zeitgleicher Anmeldung einen Rabatt von **20%**.

Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung Ihre Anmeldebestätigung/Rechnung. Bitte überweisen Sie den Rechnungsbetrag innerhalb von 30 Tagen nach Zugang der Rechnung.

Eine Stornierung Ihrer Anmeldung ist nicht möglich. Eine kostenfreie Vertretung durch Ersatzteilnehmer beim gebuchten Termin dagegen schon. Der Name des Ersatzteilnehmers muss dem Veranstalter jedoch spätestens vor Seminarbeginn mitgeteilt werden. Wir weisen darauf hin, dass „Teilnahmen“ von anderen als den gebuchten Teilnehmern nicht gestattet sind und Schadensersatzansprüche des Veranstalters auslösen. Filmmitschnitt

Bei Absage durch den Veranstalter wird das volle Seminarentgelt erstattet. Darüber hinaus bestehen keine Ansprüche. Änderungen des Programms aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

Durch die Teilnahme am Seminar erhalten Sie 4 CPE-Punkte als Weiterbildungsnachweis für Ihre Zertifizierung

\* zzgl. 19 % MwSt. \*\* inkl. 7 % MwSt. \*\*\* zzgl. 7 % MwSt.

## Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die FCH AG und ihre Dienstleister (z. B. Lettershop) verwenden Ihre personenbezogenen Daten für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen ausgewählte Fach- und Produktinformationen per Post zukommen zu lassen. Sie können der Verwendung Ihrer Daten jederzeit durch eine Mitteilung per Post, E-Mail oder Telefon widersprechen.

Senden Sie mir bitte Fach- und Produktinformationen sowie die Banken-Times SPEZIAL für meinen Fachbereich kostenfrei an meine angegebene E-Mail Adresse (Abbestellung jederzeit möglich).

**Senden Sie uns Ihre Bestellung per Mail an:**  
[info@fch-gruppe.de](mailto:info@fch-gruppe.de)

**oder schriftlich an:**  
FCH AG  
Im Bosseldorn 30, 69126 Heidelberg  
Fax: +49 6221 99898-99

**Weitere Informationen erhalten Sie unter:**  
+49 6221 99898-0  
oder unter [www.FCH-Gruppe.de](http://www.FCH-Gruppe.de)

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen

Anmelden / Bestellen