

Einfluss der starken Zinserhöhung, aktuellen ESG-Entwicklung, geopolitischen Risiken und sich abzeichnenden Rezession auf die Risikoberichterstattung!

Risiko-Reporting an neue Risikotragfähigkeit und Risikolagen anpassen



Berichterstattung über (Risiko-)Tragfähigkeit des Geschäftsmodells • Anforderungen an Datenqualität, -verfügbarkeit, -konsistenz • Synergieeffekte zum Aufsichts-Reporting

Überwachung der internen Berichterstattung über die (Risiko-)Tragfähigkeit der (LSI-) Geschäftsmodelle

- Grundlagen der **Beurteilung** der **Säule 2-Verfahren** unter Berücksichtigung von **Proportionalitätsaspekten**
- Sicherstellung der **Befugnisse** und eines uneingeschränkten, **jederzeitigen Zugangs** zu allen **(Risiko-)Daten**
- Überwachung aufsichtlicher Vorgaben an **Risikoberichte**: u.a. Handhaben von vorläufigen Daten oder Daten aus Vorperioden • **Ertrags-** und **Kostenaspekte** berücksichtigen • Umgang mit **Stresstest-Ergebnissen** sowie Berichtsturnus • Anlass für **Ad hoc-Reporting** • Umfang der **Management Summary** an das Aufsichtsorgan
- Überprüfung der **Informationen über sonstige** als **wesentlich** identifizierte **Risiken** – Einschätzung aktueller **Zinsänderungsrisiken**, **geopolitischer Bedrohungen** und künftiger Nachhaltigkeits-/ESG-Faktoren
- Bewertung der **Abbildung** der **normativen** (u.a. mehrjährige Kapitalplanung) und **ökonomischen** (Barwert/-nahen) **Risikotragfähigkeit-Perspektive** im Berichtswesen – Zum **Nachweis** hoher Qualität des angesetzten Kapitalbedarfs zur tatsächlichen Risikoabsorption
- **Prüfansätze/-felder**, **Feststellungen** und **Erwartungen** der Aufsicht an Berichterstattung über den ICAAP

(danach 15 min. Pause)

10:00 - 11:30 Uhr

Dr. Markus Machill

Referat Bankgeschäftliche Prüfungen
Deutsche Bundesbank

Prüfungsleiter in der Hauptverwaltung für Bremen, Niedersachsen und Sachsen-Anhalt in Hannover. Langjährige Erfahrungen mit 44er Prüfungen im Bereich Gesamtbanksteuerung und Risikomanagement.

Aufbau & Pflege eines zeitnahen Risiko-Reporting zur wirksamen Unterstützung der Gesamtbanksteuerung

11:45 - 13:15 Uhr

Mag. Stefan Millinger

Bereichsleitung Risikomanagement
Bankhaus Carl Spängler & Co.
Aktiengesellschaft

Seit 2015 als Bereichsleiter
verantwortlich für Risikomanagement
und Gesamtbanksteuerung, u.a. auch
für die bankinterne Neuausrichtung
der Risikotragfähigkeitskonzepte.

- **Aktualisierung** der Risikoberichterstattung infolge der aktuellen **Zinsänderungs-**, **geopolitischen** und **ESG-Risiken** sowie **regulatorischen** Neuregelungen
- **Anpassungen** in der institutsindividuellen **Risikoinventur** als Voraussetzung für Überarbeitungen im Risikoberichtswesen – Wesentlichkeitseinstufung **neuer** Risiken? • Umgang mit **schwer quantifizierbaren** Risiken
- **Neuausrichtung der Risikotragfähigkeit** – Einfluss auf **ICAAP-Reporting**: Kommentierung der Ergebnisse des (Kapital-) **Planszenarios** • Erläuterung der Ergebnisse aus **Stresstests** und **adversen** Szenarien • Angaben zum **Risikodeckungspotenzial (RDP)**, Risikohorizont und Höhe des **Konfidenzniveaus**
- Reporting über Entwicklung der aufsichtlichen **Kapitalanforderungen**: u.a. Einbinden der erwarteten **SREP-Beurteilung/-Zuschläge** in den **Gesamtrisikobericht** • Auswirkung der Erhöhung/Neufestsetzung von **Kapitalpuffern** auf die (Risiko-)Tragfähigkeit des Geschäftsmodells
- Dokumentation der Ableitung des **Managementpuffers** als Ausdruck des **Risikoappetits**: ggf. Erläuterungen über **RDP-Herleitung** bis in Detail-Risikoberichte zur nachvollziehbaren Ableitung von Steuerungsimpulsen
- **Synergieeffekte** bei Aufbereitung der geforderten Plan-, Ertrags- und Risikodaten **fürs Aufsichts-Reporting**
- Musterdarstellung für Kontrollmöglichkeiten zur **Sicherstellung** der **Datenqualität** im Berichts-/Meldewesen

Mit freundlicher Unterstützung unseres namhaften und etablierten Kooperationspartners:



Risiko-Reporting an neue Risikotragfähigkeit und Risikolagen anpassen

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Risiko-Reporting an neue Risikotragfähigkeit und Risikolagen anpassen



15.06.2023 (230630)

379,00 €*

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	322,15 €
Treue PLUS 20	303,20 €
Treue PLUS 25	284,25 €

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

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:
(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Die Errichtung interner **Prozesse** zur Sicherstellung der **Risikotragfähigkeit** und Beurteilung der **Kapitalausstattung** (ICAAP) ist ein wesentlicher Bestandteil des Risikomanagement, da sie Einfluss auf die Einhaltung der Kapitalanforderungen und Festlegung des **SREP-Kapitalzuschlags** hat. Sowohl die EZB als auch die BaFin greifen auf **detaillierte ICAAP-Grundsätze** zurück, deren Anforderungen sie bei ihren Prüfungen heranziehen. Daneben erfordert die **Neuausrichtung der Risikotragfähigkeit** (u.a. mehrjährige Kapitalplanung, Barwert/-nahe Analyse von Vermögen und Risiken) sowie **Zinsänderungs- und bislang vernachlässigte** (z.B. ESG-, geopolitische) **Risiken** eine anlass(un)abhängige **Anpassung** der institutsspezifischen Berichterstattung, um ggf. **Steuerungskennzahlen** und Handlungsempfehlungen in Risikoreports und der Management Summary **neu aufzubereiten**.

15.06.2023 10:00 bis 13:00 Uhr

Online-Veranstaltung mit Zoom. Zoom ist der erste Anbieter von Videokonferenzlösungen, dessen Software im Jahr 2021 vom BSI nach dem internationalen Standard Common Criteria zertifiziert wurde.

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 Seminardokumentation 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.

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.

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

Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die Finanz Colloquium Heidelberg GmbH 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

oder schriftlich an:
Finanz Colloquium Heidelberg GmbH
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

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen

Anmelden / Bestellen