

Inwieweit passen aktuelle Erkenntnisse über stark gestiegene Zinsen noch zur Story-Line des Stresstest-Szenarios „schwerer konjunktureller Abschwung“?



Risikomessung: Umgang mit Modellschwächen • adverse/Stress-Szenarien

Modul 2: Validierung von Messverfahren • Stress-Szenarien zur Bewertung der Risikotragfähigkeit des Geschäftsmodells • Expertenschätzung bei fehlenden historischen Daten

Mit diesem und weiteren Seminaren können Sie auch ein Zertifikat erwerben, alle Infos finden Sie hier: [Zertifizierter Risikomanager Banken \(FCH\), SE2407002, 01.07.2024 - 04.07.2024](#)

- **Bewertung** und Einschätzung wesentlicher Risiken durch quantitative und qualitative **Risikomessverfahren**
- Angemessene **Annahmen**, valide **Parameter** und verfügbare **Bewertungsdaten** zur Risikoquantifizierung
- Prüfung der **Prognosegüte** der Risikomodelle (**Validierung**): regulatorische Vorgaben • qualitative und quantitative Aspekte • statistische Methoden • Abweichungsanalysen • Interpretation der Validierungsergebnisse
- **Stresstests** sowie **adverse Szenarien** zur Bewertung der (Risiko-)Tragfähigkeit des **Geschäftsmodells**: aufsichtliche Leitplanken • Auswirkungen auf strategische Planungsaktivitäten und das Gesamtbankrisikoprofil
- **Validierung** interner **Stresstest-Programme**: **Überprüfung** der Annahmen, Risikofaktoren, Methoden und Daten • Ableitung angemessener **Parametrisierung** für zusätzliche Stressszenarien – Herausforderungen bei **fehlenden** historischen **Daten** (z.B. zu Kreditspreadrisiken) • Einsatz von Praktiker-/**Expertenschätzungen**?

(dazwischen 15 min. Pause)

10:00 - 13:00 Uhr

Christian Schnabel

Vorstandsvertreter, Bereichsdirektor
Unternehmensentwicklung
Sparkasse Hildesheim Goslar Peine

Langjährige Erfahrungen im Bereich
Gesamtbanksteuerung und
Risikomanagement. Aufbau eines
Risikoüberwachungsverfahrens/
steuerungssystem nach § 25a KWG.
Sehr erfahrener Referent; vormals
mehrere Jahre Leiter der Internen
Revision der Sparkasse Hildesheim.

Risikomessung: Umgang mit Modellschwächen • adverse/Stress-Szenarien

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

**Risikomessung: Umgang mit Modellschwächen •
adverse/Stress-Szenarien**
02.07.2024 (SE2407004)



399,00 €*

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

Wenn Sie eine individuelle Beratung zum Thema benötigen, unterstützen wir Sie gerne, klicken Sie hier:
<https://www.fch-gruppe.de/consult>



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 Seminardokumentation)



Anmelden / Bestellen

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:
(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Die **quantitative** und **qualitative Messung** bankbezogener Risiken ist ein wesentlicher Bestandteil des Risikomanagement-Prozesses. Hierbei fällt den herangezogenen **Annahmen, Risikoparametern** und verfügbaren konsistenten **Bewertungsdaten** eine besondere Rolle zu. Das Risikocontrolling hat insbesondere die **Prognosegüte** der eingesetzten **Risikomodelle** und **Stresstest-Programme zu überprüfen (Validierung)** sowie deren **Ergebnisse zu interpretieren** und zu dokumentieren. Dies ist umso wichtiger, da in der Regel am Ende unzähliger Prüfschritte der Vorstand die ausgearbeiteten Excel-Vorlagen und die qualitativen Einschätzungen unterschreibt. Außerdem ist die **Angemessenheitsprüfung** von Risikomessverfahren und Stresstests wichtiger Bestandteil **aufsichtlicher** Anforderungen und kann erheblichen **Einfluss auf die Risikoprofilnote** und den **SREP-Zuschlag** nehmen.

02.07.2024 10:00 bis 13:00 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 Seminardokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei gemeinsamer Anmeldung in derselben Buchung 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

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

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen