

Umgang mit Modellrisiken: Zinsbuch-Stresstests & adverse Zinsszenarien

**Modellunsicherheit/-schwächen infolge unvollständiger Datenhistorien •
(Stress-)Szenario-Analysen zur Ableitung plausibler Zinsstrukturkurven in
der Barwert- und GuV-Welt**

**Mit diesem und weiteren Seminaren können Sie auch ein Zertifikat
erwerben, alle Infos finden Sie hier: [Zertifizierter Spezialist
Zinsrisikomanagement \(FCH\), SE2503018, 17.03.2025 - 20.03.2025](#)**

- **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**
- Beachtung regulatorischer Anforderungen an **Verwendung** von **Modellen** aus **neuem AT 4.3.5. der MaRisk**
- **BTR 2.3. MaRisk 9.0: Ergänzungen** in Bezug auf die **Modellierung** von IRRBB-Szenarien (u.a. Umfang, Messung, Dokumentationsstand)
- IRRBB-Reporting-Anforderungen und Betrachtung des **Zinsbuch-Stresstest-Reporting**
- 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 **ökonomischen** und **normativen** 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 der eigenen **Risikotragfähigkeit** heraus
- **Validierung** bzw. **Backtesting** der verschiedenen Zinsbuch-Stresstests und barwertigen Zinsrisikomodelle zur **Reduzierung** von **Modellrisiken**
- **Anlass(un)abhängige** Zinsbuch-Stresstests in Abhängigkeit von der **Portfoliostruktur** und **Risikosituation**
- **Impulse** aus Zinsbuch-**Stresstest-Ergebnissen** 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

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

(dazwischen 15 min. Pause)

Umgang mit Modellrisiken: Zinsbuch-Stresstests & adverse Zinsszenarien

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Umgang mit Modellrisiken: Zinsbuch-Stresstests & adverse Zinsszenarien

18.03.2025 (SE2503020)



469,00 €*
469,00 €

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	398,65 €
Treue PLUS 20	375,20 €
Treue PLUS 25	351,75 €

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 Semindokumentation)



Name:	
Vorname:	
Position:	
Abteilung:	
Firma:	
Straße:	
PLZ/Ort:	
Tel.:	
Fax:	
E-Mail:	
Rechnung an: (Name, Vorname)	
(Abteilung)	
E-Mail:	
Bemerkungen:	

Nach den **stark gestiegenen** Zinsen bis 2023 und ersten **Zinssenkungen** seit 2024 befinden sich viele (LSI-) Institute auf der Suche nach geeigneten **Annahmen**, validen **Risikoparametern** und zuverlässigen **Bewertungsdaten** im Rahmen der (barwertigen) **Zinsbuchsteuerung**. Herausfordernd sind v.a. **Zinsbuch-Stresstests** und **adverse Szenarien für Zinsstrukturkurven** in Barwert- und GuV-Welt, z.B. die Ableitung **plausibler Stresskurven** – auf Basis einer historischen barwertigen VaR-Simulation oder Expertenschätzung – für die ökonomische und normative **Risikotragfähigkeit**-Perspektive. Dies erfordert u.a. die **Validierung** bzw. **Backtesting** der verschiedenen Zinsbuch-Stresstests und barwertigen Zinsrisikomodelle zur **Reduzierung von Modellrisiken** unter Berücksichtigung regulatorischer **Anforderungen** an die **Verwendung von Modellen** aus dem **neuen AT 4.3.5. der MaRisk**.

18.03.2025 14:00 bis 17:00 Uhr

Tagungsort

ONLINE-Veranstaltung mit ZOOM, der Zugang erfolgt über "meinFCH", Sie erhalten rechtzeitig vor dem Seminar eine E-Mail, Zoom, Tel +49 6221-998980,

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 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. ** 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

Anmelden / Bestellen