

Neue IRRBB-Meldevorgaben: Fallstricke • Erfahrungen • Umsetzungstipps

Barwertige (EVE) & Periodische (NII) Perspektive • neuer „Ausreißertest“ (SOT) • Zusammenspiel IRRBB mit Gesamtstrategie & Reporting • SREP-Wechselwirkungen mit EVE & NII

- Kritische Würdigung der **neuen Leitlinien** für Zinsänderungsrisikos im Bankbuch (IRRBB), Regelungen zum vereinfachten Standardansatz und aufsichtlichen „Ausreißertest“ – Was kommt auf die deutschen Banken zu?
- **Standardansatz zur Quantifizierung** des barwertigen und periodischen **Risikos** am **Praxisbeispiel**: Voraussetzungen für Nutzung der **vereinfachten Methode** • Ausgestaltung des Standardansatzes für die **periodische Perspektive**
- **Praxisnahe Validierung** der Ergebnisse • **Plausibilisierung** von Margen- und Zinsentwicklungen • korrekte Umsetzung der statischen Bilanzannahme • Vergleich mit Ergebnissen des LSI-Stresstests
- **Barwertiger** und **periodischer „Ausreißertest“**: was ist ein periodisches **Ausreißer-Kriterium**? • worauf ist bei Festlegung der Modell- und Parameterannahmen sowie **Schockszenarien** zur Messung und Bewertung des Barwertverlusts (Rückgangs des wirtschaftlichen Werts des Eigenkapitals – EVE) bzw. Zinsüberschusses (Nettozinsenertrags – NII) zu achten?
- Mindestanforderungen an **Risikomessung/-systeme** zur Ermittlung, Bewertung, Steuerung und Eindämmung des Zinsänderungsrisikos im Bankbuch (IRRBB) – Praxistipps zur grds.(methodischen) **Vorgehensweise**
- **Auswirkungen** des IRRBB-Meldewesens auf die **Banksteuerung**: Bereitstellung periodischer und barwertiger **quantitativer Daten** • Anpassung von (**Schock**-) **Szenarien** und **Governance** der Zinsrisikosteuerung (Zinsrisikostrategie) • Würdigung der Ergebnisse des NII Supervisory Outlier Tests (SOT) im **Risikoappetit**
- **Auswirkungen** der IRRBB-Neuregelungen **auf** die Ermittlung und Prognose des SREP-Kapitalzuschlags

(dazwischen 15 min. Pause)

10:00 - 13:00 Uhr

Tim-Oliver Engelke

Bereichsleiter Gesamtbanksteuerung
Kreissparkasse Düsseldorf

Leiter der Risikocontrolling-Funktion. Vormalig Spezialist im Controlling der Sparda-Bank Hessen; davor Referent für Gesamtbanksteuerung und Bankenaufsichtsrecht beim Verband der Sparda-Banken. Autor mehrerer Fachpublikationen.

Neue IRRBB-Meldevorgaben: Fallstricke • Erfahrungen • Umsetzungstipps

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Neue IRRBB-Meldevorgaben: Fallstricke • Erfahrungen • Umsetzungstipps



24.06.2025 (SE2506028)

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 Seminardokumentation)

Anmelden / Bestellen

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:

(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

(LSI-)Institute müssen **neue Meldeanforderungen an Zinsänderungsrisiken im Bankbuch (IRRBB)** beachten. Demnach sind Kriterien für die Ermittlung, Überwachung, Steuerung des IRRBB und seine Bewertung in **Risikomesssystemen** sowie Voraussetzungen für den (vereinfachten) **Standardansatz** zur Quantifizierung des barwertigen und periodischen Risikos zu erfüllen. Daneben sind im **aufsichtlichen Ausreißertest (SOT)** Modellierungsannahmen und Schockszenarien festzulegen, die Institute zur Bewertung des Rückgangs des wirtschaftlichen Werts des Eigenkapitals (EVE) und Nettozinsetrags (NII) im SREP anzuwenden haben. Die Neuregelungen im **IRRBB-Meldewesen** führen zu **methodischen und konzeptionellen Anpassungen** in der **Banksteuerung** (u.a. Lieferung quantitativer Daten, Offenlegung qualitativer Modellannahmen) und haben **Auswirkungen auf den SREP-Kapitalzuschlag**.

24.06.2025 10:00 bis 13:00 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 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 3 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