

# ≡ RISIKOMANAGEMENT IN BANKEN

## ÖKONOMISCHE METHODEN FÜR DEN RISIKOCONTROLLING- UND -STEUERUNGSPROZESS

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Das Risikomanagement hat eine zentrale Bedeutung in der aktiven Gestaltung und Steuerung.</p> <p>Das Seminar bietet einen Überblick über die verschiedenen Bereiche und Fragestellungen im aktiven Risikomanagement. Dabei werden die wichtigsten Themen und Methoden skizziert und unter Einbindung aktueller Entwicklungen in den Gesamtkontext eingebettet.</p> <p>Das Seminar wendet sich vor allem an Mitarbeiter, die sich neu in das Themengebiet einarbeiten bzw. eine Auffrischung hinsichtlich der verschiedenen Aspekte wünschen.</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>≡ Aufsichtliche Anforderungen an das Risikomanagement als Rahmen für die Gesamtbanksteuerung</li> <li>≡ Grundlegende Begriffe und Ansätze im Risikomanagement <ul style="list-style-type: none"> <li>● Ergebnisorientierte und substanzwertorientierte Steuerung</li> <li>● Going- und Gone-Concern</li> </ul> </li> <li>≡ Messmethoden für einzelne Risikoarten <ul style="list-style-type: none"> <li>● Überblick über die typischen Verfahren für die wesentlichen Risikoarten</li> <li>● Kalkulation eines Value at Risk für Marktpreisrisiken mittels historischer Simulation</li> <li>● Messung von Kreditrisiken: faire Bepreisung von Krediten und Standardverfahren für die Risikomessung</li> <li>● Operationelle Risiken: Identifikation und Beurteilung bedeutender operationeller Risiken</li> <li>● Liquiditätsrisiken: Liquidity Value at Risk und vereinfachte Messmethoden</li> </ul> </li> <li>≡ Risikotragfähigkeit <ul style="list-style-type: none"> <li>● Übergeordnetes Konzept</li> <li>● Typische Umsetzungsvarianten aus der Praxis</li> </ul> </li> <li>≡ Limitkonzept <ul style="list-style-type: none"> <li>● Ansatz für die Limitierung der Gesamtbank</li> <li>● Aggregation von Risiken und Disaggregation von Limiten</li> </ul> </li> <li>≡ Monitoring und Reporting <ul style="list-style-type: none"> <li>● Generelle Anforderungen an ein Reporting</li> <li>● Spezielle Anforderungen: Risikoreportingsysteme, Beispiele für Risikoreports für verschiedene Risikoarten</li> </ul> </li> </ul>	<p><b>KATEGORIE Grundlagen</b></p> <p>G A P R</p> <hr/> <p><b>SEMINARDAUER</b></p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p><b>SEMINARNUMMER G_02</b></p> <hr/> <p><b>SPEZIALISIERUNG</b></p> <p>Als Spezialisierung können alle Themengebiete des Seminars angeboten werden. Für spezielle Zielgruppen (z.B. IT-Mitarbeiter) können individuelle Veranstaltungen mit entsprechenden Schwerpunkten und Themengebieten zusammengestellt werden.</p>