

# MARKTRISIKO – DIE NEUEN BASLER UND EU-ANFORDERUNGEN (FRTB)

## RISIKOMESSUNG UND EIGENMITTELANFORDERUNGEN DER SÄULE 1 NACH DEM STANDARDANSATZ

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>In dem Seminar wird der neue Standardansatz für das Marktrisiko nach den Basler Regelungen im Detail vorgestellt. Die Regelungen sollen ab 1. Januar 2022 Anwendung finden. Die Teilnehmer sollten nach dem Seminar ein umfassendes Verständnis der Methoden und technischen Herausforderungen besitzen. Der Schwerpunkt des Seminars liegt auf dem sogenannten Sensitivitätsbasierten Ansatz (SbA), bei dem die Sensitivitäten Delta, Vega und Curvature im Kontext der verschiedenen Risikoklassen sowie die Verfahren der Risikoaggregation vorgestellt werden. Die Regelungen werden anhand zahlreicher Beispiele illustriert.</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>☰ Vorbemerkungen               <ul style="list-style-type: none"> <li>● Abgrenzung des Handelsbuchgeschäfts</li> <li>● Umwidmung von Geschäften</li> <li>● Interner Risikotransfer</li> </ul> </li> <li>☰ Der Sensitivitätsbasierte Ansatz (Delta, Vega, Curvature, Portfolioaggregation)               <ul style="list-style-type: none"> <li>● Allgemeines Zinsänderungsrisiko</li> <li>● Creditspread-Risiko für Nicht-Verbriefungen</li> <li>● Creditspread-Risiko für Verbriefungen (ohne Instrumente des Korrelationshandels)</li> <li>● Aktienrisiko</li> <li>● Fremdwährungsrisiko</li> <li>● Warenrisiko</li> </ul> </li> <li>☰ Ausfallrisiko</li> <li>☰ Residualrisiko</li> </ul>	<p><b>KATEGORIE</b> Aufsichtsrecht</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p><b>SEMINARDAUER</b></p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p><b>SEMINARNUMMER</b> A_20</p> <hr/> <p><b>SPEZIALISIERUNG</b></p> <p>Als Spezialisierung kann eine Vertiefung der Anforderungen an Interne Modelle für die aufsichtliche Eigenmittelunterlegung angeboten werden. Darin enthalten sind beispielsweise qualitative/ quantitative Anforderungen, Überblick über Risikomodellstandards, Beispielrechnungen, Validierung des Risikomodells, das grundsätzliche Prüfungsverfahren.</p>