

PRÜFUNGSANSÄTZE FÜR DIE GESAMTBANKSTEUERUNG

RISIKOMESSMETHODEN UND ÜBERGEORDNETE SICHT AUF DIE RISIKOTRAGFÄHIGKEIT

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Die regulatorischen Anforderungen an die Institute haben eine nie dagewesene Komplexität und Tiefe erreicht. Sie erstrecken sich insb. über die Sicherstellung der Risikotragfähigkeit und der Verwendung adäquater Risikomessmethoden. Vor diesem Hintergrund kommt der internen und externen Revision in den Instituten eine besondere Bedeutung zu. Das Seminar soll Ihnen hierzu eine wichtige Hilfestellung geben. Für ausgewählte zentrale Teilbereiche der Gesamtbanksteuerung werden, aufbauend auf der Darstellung der methodischen Sachverhalte, die jeweils spezifischen aufsichtlichen Anforderungen angeführt und konkret gezeigt, welche Fragen im Rahmen von Prüfungsplänen gestellt werden müssen.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ☰ Übergeordnete Fragestellungen zur Risikotragfähigkeit <ul style="list-style-type: none"> ● Normative Perspektive und Going Concern alter Prägung ● Ökonomische Perspektive ● Abgrenzung von barwertigen und ergebnisorientierten Methoden ☰ Kreditrisiko <ul style="list-style-type: none"> ● Kreditpricing ● Arten von Kreditrisikomodellen ● Typische Prüfungsfeststellungen ☰ Zinsrisiko <ul style="list-style-type: none"> ● Unterschiede von barwertigen und ergebnisorientierten Methoden ● Anforderungen an die Modellierung von Cashflows ● Vorstellung einer Beispielrechnung für eine historische Simulation und die Varianz-Kovarianz-Methode ● Ansätze für Prüfungen und typische Feststellungen ☰ Refinanzierungsrisiko <ul style="list-style-type: none"> ● Abgrenzung der verschiedenen Arten des Liquiditätsrisikos ● Modellierung der Cashflows aus Liquiditätssicht, Abgrenzung zur Modellierung für das Zinsrisiko ● Volumenbezogene Messansätze und LVaR ☰ Validierung <ul style="list-style-type: none"> ● Quantitative Validierung: Backtesting versus Benchmarking ● Qualitative Validierung: Modelldesign, Datenqualität und Use Test ● Validierung von Parametern versus Risikomodellen ☰ Modellrisiko <ul style="list-style-type: none"> ● Abgrenzung zum operationellen Risiko ● Scoring von Modellrisiken ● Visualisierung von Modellrisiken via Heatmaps ● Quantifizierung von Modellrisikopuffern ● Model Risk Policy 	<p>KATEGORIE Risikomanagement</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER R_16</p>