

STRESSTESTS IN BANKEN

REGULATORISCHE ANFORDERUNGEN UND METHODEN FÜR STRESSTESTS

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Die Seminarteilnehmer erhalten eine kompakte Einführung in die Thematik der Stresstests.</p> <p>Das Seminar umfasst eine Einführung in die bankaufsichtlichen Anforderungen (Aufsichtsrecht aktuell: EBA Guideline Stresstesting).</p> <p>Zudem erhalten die Teilnehmer einen Überblick über bankpraktische Umsetzungen in den wesentlichen Risikoarten sowie die Einbindung von Szenario- und Stresstestanalysen in die Gesamtbank. Abschließend werden Anforderungen aus aufsichtlichen Stresstests und damit verbundene Herausforderungen vorgestellt.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ☰ Die Anforderungen der Aufsicht <ul style="list-style-type: none"> ● Basel und EU, EBA Leitlinien, EBA-Stresstest ● CRR und MaRisk ● EBA Guideline zu internen Stresstests ☰ Stresstests für Marktrisiken <ul style="list-style-type: none"> ● Risikofaktoren und Ausgestaltung von Szenarien ● Stresstests für das Zinsänderungsrisiko ● VaR und Stresstests, MC-Simulation, Expected Shortfall ☰ Stresstests für Kreditrisiken <ul style="list-style-type: none"> ● Typische Stresstests ● Rezession, PD-/LGD-Stress-Szenarien, ● EBA-Stresstest, Migrationsmatrizen ● Makroökonomische Szenarien ● Konzentrationsrisiken ☰ Stresstests für Liquiditätsrisiken <ul style="list-style-type: none"> ● Nettomittelabfluss und Liquiditätsablaufbilanz ● LCR und NSFR ● Gap-Analyse ● Liquidity-VaR und Liquidity at Risk ☰ Einsatz von Stresstests und Szenarioanalysen für die Gesamtbank <ul style="list-style-type: none"> ● Stresstest Frameworks unter SREP / MaRisk ● Szenarioanalysen als zentrales Element einer modernen Gesamtbanksteuerung ● Belastungsanalysen in der Sanierungsplanung ● Inverses Stresstesting in der Bankpraxis ☰ Aufsichtliche Stresstests <ul style="list-style-type: none"> ● Übergreifende Methodik EBA-Stresstest und LSI-Stresstest ● Aufsichtliche Erwartungshaltung und Bewertung ● Kritische Punkte und praktische Herausforderungen 	<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_11</p> <hr/> <p>SPEZIALISIERUNG</p> <p>Vertiefungen hinsichtlich verschiedener Schwerpunkte</p> <ul style="list-style-type: none"> ● Risikoarten (Kreditrisiko, Marktpreisrisiko, Liquiditätsrisiko) ● Gesamtbanksteuerung (SREP, ICAAP, ILAAP, Geschäftsmodell) ● Sanierungsplanung und Abwicklungsplanung