

≡ ZINSÄNDERUNGSRISIKO IM ANLAGEBUCH IM KONTEXT VON ICAAP UND GESAMTBANKSTEUERUNG

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Ein Punkt der aufsichtlichen Agenda für die vergangenen und auch noch kommenden Jahre ist das Management des Zinsänderungsrisikos im Anlagebuch (IRRBB). In dem Seminar werden die aktuellen regulatorischen Anforderungen, die Integration des IRRBB in den aufsichtlichen Überprüfungsprozess (SREP) sowie die aufsichtsrechtlichen Grundlagen dargestellt. Darüber hinaus wird die Anwendung verschiedener Messmethoden erläutert. 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"> ≡ Überblick – Standardsetter und regulatorische Anforderungen an das Zinsänderungsrisiko im Anlagebuch <ul style="list-style-type: none"> ● Aufsichtsbehörden und Gremienlandschaft ● Gesetze, Verordnungen, Leitlinien und technische Standards ● EBA Guidelines, BCBS-Standards und Integration in die CRR /CRD IV sowie nationale Anforderungen ● Allgemeiner Überblick über Inhalte der Regularien sowie grundlegende Begriffe ≡ Details – EBA Guidelines on the management of interest rate risk arising from non-trading book activities (EBA/GL/2018/02) <ul style="list-style-type: none"> ● Anforderungen an die Governance ● Anforderungen an die Messmethoden und das Stresstesting ● Anforderung an die Modellierung von Positionen ● Betrachtung der Überlegungen zum Baseler Zinsschock ≡ Der Standardansatz des BCBS <ul style="list-style-type: none"> ● Darstellung des Vorgehens innerhalb des Standardansatzes und Herausforderungen ● Bestimmung der Stressszenarios für den Standardansatz ≡ Der Supervisory Review und Evaluation Process (SREP) – Überblick über die Vorgaben und Integration des IRRBB <ul style="list-style-type: none"> ● Gesetzliche Rahmenbedingungen und Akteure ● Prozessualer Ablauf des SREP ● Festlegung von Kapitalzuschlägen auf nationaler sowie europäischer Ebene ≡ Barwertige Messmethoden und ihre Umsetzung (Schwerpunkt VaR) <ul style="list-style-type: none"> ● Übersicht über barwertige Messmethoden ● Betrachtung der verschiedenen Ansätze zur Bestimmung des VaR ≡ Ertragsorientierte Messmethoden und ihre Umsetzung <ul style="list-style-type: none"> ● Darstellung der Wiederanlage für die Messung des Ertragsrisikos ● Zinsbindungsbilanz als Ausgangspunkt für die Gap-Analyse ● Dynamisches Messverfahren in Form von Szenariobetrachtungen und eines Earnings-at-Risk-Ansatzes ≡ Fallstudie und Rechenbeispiel 	<p>KATEGORIE Aufsichtsrecht</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER A_07</p>