Akademie der
Sparkassen-Finanzgruppe Saar

Stresstests und Konzentrationsrisiken

Seminarnummer	16.03.618.04
Termin	Mittwoch, den 02.03.2016 bis Donnerstag, den 03.03.2016
- Zeit	08:30 Uhr bis 16:30 Uhr
- Ort	Raum 3, Akademie der Sparkassen-Finanzgruppe Saar
- Referent/in	Christoph Bleses und Dr. Michael Lesko, Fa. IC nova, Karlsruhe
Zielgruppen	Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Treasury, Risikocontrolling und Revision sowie Vorstandsmitglieder mit Interesse an Detailwissen
Zielsetzung	Die Durchführung von Stresstests ist eine zentrale Herausforderung für alle Finanzinstitute. Stresstests liefern eine wertvolle Ergänzung zur "Normal-Case" -Steuerung der Bank. Im Rahmen des Seminars werden aufsichtsrechtliche Anforderungen und deren Interpretation sowie lösungsorientierte Ansätze zur Umsetzung der Stresstests in der Praxis aufgezeigt. Die Identifikation von Risikokonzentrationen ist für Banken von zentraler Bedeutung. Sie sind in der Regel die Hauptursache für Schieflagen oder die Insolvenz eines Hauses. Zusätzlich werden Wege zur Identifikation und Quantifizierung diskutiert sowie Möglichkeiten zur Einbeziehung in die Steuerung aufgezeigt.
Inhalte	• Überblick und Einführung • Aktuelle aufsichtsrechtliche Anforderungen an Stresstests und Risikokonzentrationen • Betriebswirtschaftliche Grundlagen zu Stresstests • Betriebswirtschaftliche Grundlagen zu Ertrags- und Risikokonzentrationen • Stresstests für Adressen- und Spreadrisiken im Kunden- und Eigengeschäft • Stresstests für Marktpreisrisiken • Stresstests für Liquiditätsrisiken • Stresstests für Operationelle Risiken • Diversifikation in risikoartenübergreifende Stresstests • Ergebnisse der Stresstests
Hinweis	Teilweise werden Excelbeispiele zur Illustration eingesetzt. Diese werden den Teilnehmern zur Verfügung gestellt.
Zuständig	
- Organisation	Backes, Timo timo.backes@svsaar.de
- Inhalt	Stephan, Lisa-Marie lisa-marie.stephan@svsaar.de
Meldeschluss	Freitag, den 05.02.2016