

Gesamtbanksteuerung aus Sicht der Prüfung

Seminarnummer	18.11.6062.02
Termin	Montag, den 05.11.2018 bis Dienstag, den 06.11.2018
- Zeit	08:30 Uhr bis 16:30 Uhr
- Ort	Raum 2, Akademie der Sparkassen-Finanzgruppe Saar
- Referent/in	Frank Blass und Martin Feix, ICnova AG
Zielgruppen	Fach- und Führungskräfte der Innenrevision, Mitarbeiter/innen von Prüfungsverbänden und Prüfungsgesellschaften.
Zielsetzung	<p>Das Seminar gibt übersichtlich aufbereitet und verständlich dargestellt, einen fachlichen und methodischen Überblick zu den wesentlichen Inhalten einer modernen Gesamtbanksteuerung. Darauf aufbauend werden für die zentralen Prüfungsfelder Marktpreis-, Liquiditäts- und Adressenrisiken sowie Risikotragfähigkeit aktuelle Fragestellungen diskutiert. Häufig auftretende Fehler in der Praxis-Umsetzung der Steuerungsansätze werden besprochen und Lösungsansätze diskutiert.</p> <p>Zielsetzung der Veranstaltung ist die zielgruppenorientierte Vermittlung des notwendigen Wissens zur Gesamtbanksteuerung sowie die Sensibilisierung für kritische Umsetzungsaspekte.</p>
Inhalte	<ul style="list-style-type: none">• Aktuelle aufsichtsrechtliche Themen<ul style="list-style-type: none">◦ Aktuelle Weichenstellungen der Bankenaufsicht◦ Einordnung der aktuellen Entwicklungen in der Bankenaufsicht (SREP/IRRBB/BCBS 368)◦ MaRisk als Herzstück der qualitativen Aufsicht• Überblick Gesamtbanksteuerung<ul style="list-style-type: none">◦ Themenfelder der Gesamtbanksteuerung◦ Schwerpunkte der vertieften Betrachtung im Seminar• Prüfungsfeld "Marktpreisrisiken"<ul style="list-style-type: none">◦ Zinsrisikomanagement mit den Schwerpunkten Variables Geschäft und Mischungsverhältnisse◦ Geeignete Zeitreihen zur Zinsrisikomessung und Konsistenz◦ Periodisches Zinsspannenrisiko◦ Bewertungsrisiko Wertpapiere◦ Wertorientierte Zinsbuchsteuerung◦ Anforderungen aus SREP, EBA-Leitlinie IRRBB und BCBS 368◦ Implizite Optionen◦ Umgang mit negativen Zinsen◦ Sonstige Marktpreisrisiken und deren Risikomanagement• Prüfungsfeld "Adressenrisiken (Kunden- und Eigengeschäft)"<ul style="list-style-type: none">◦ Kreditportfoliosteuerung Kundengeschäft◦ Ermittlung des Bewertungsergebnisses Kredit (Planwert und Wert im Risikofall)◦ Adressen-, Migrations- und Spreadrisiken im Eigengeschäft◦ Exkurs: Fonds im Risikomanagement und deren sachgerechte Behandlung• Prüfungsfeld "Liquiditätsrisiken"<ul style="list-style-type: none">◦ Zahlungsfähigkeitssicht◦ Refinanzierungsrisiko

- Liquiditätstransferpreissystem
- Prüfungsfeld "Operationelle Risiken und sonstige Risiken"
 - Risikomessung operationeller Risiken
 - Ermittlung von Vertriebsrisiken
 - Abbildung von Planabweichungsrisiken
 - Berücksichtigung von Beteiligungsrisiken
- Prüfungsfeld "Risikotragfähigkeit, Kapitalplanungsprozess und Stresstests"
 - Risikotragfähigkeit und SREP
 - Risikoinventur und Risikokonzentrationen
 - Aufbau einer periodischen Risikotragfähigkeitskonzeption
 - Betrachtung über den Bilanzstichtag hinaus – Rollierend 12M vs. Ultimo/Ultimo Folgejahr
 - Konfidenzniveau und Risikohorizont
 - Berücksichtigung begründbarer Diversifikation
 - Delta-Methode bei der Umsetzung von Ultimo/Ultimo Folgejahr
 - Kapitalplanungsprozess und Risikodeckungspotenzial
 - Struktur und Umfang von Stresstests
 - Validierung der verwendeten Modelle und Parameter
- Prüfungsfeld "Geschäfts- und Risikostrategie"
 - Konsistenz von Geschäfts- und Risikostrategie
 - Fundierung der Strategien

Zuständig

- Organisation

Backes, Timo
timo.backes@svsaar.de

- Inhalt

Stephan, Lisa-Marie
lisa-marie.stephan@svsaar.de

Meldeschluss

Freitag, den 05.10.2018