

Steuerung von Marktrisiken

SMR-25001

Zielgruppe

Controller

Ihr Nutzen

- ✓ Sie erhalten einen Überblick der Marktrisiken
- ✓ Sie kennen die Methoden zur Messung der Marktrisiken
- ✓ Sie verstehen die Auswirkungen der Marktrisiken in der normativen und ökonomischen Perspektive
- ✓ Sie können die Stresstests im Bereich der Marktrisiken durchführen
- ✓ Sie sind in der Lage Marktrisiken zu steuern

Inhalt

- ✓ Überblick der Marktrisikoaarten
- ✓ Berechnung der normativen Marktrisiken mittels der dynamische Zinselastizitätsbilanz
- ✓ Steuerung und Berechnung von Neugeschäftskonditionen
- ✓ Berechnung der ökonomischen Marktrisiken mittels des Resampling-Verfahrens
- ✓ Durchführung von Stresstest im Bereich der Marktrisiken
- ✓ Erläuterung der aufsichtlichen Anforderung zur Messung der Zinsrisiken im Anlagebuch (IRRBB)
- ✓ SREP-Systematik im Bereich der Marktrisiken
- ✓ Konzeption moderner Zinsbuchsteuerung
- ✓ Benchmarkauswahl
- ✓ Historische Simulation per Planungshorizont und Performancemessung
- ✓ Aktive versus passive Steuerung
- ✓ RORAC und Interpretation

 **Termin**
06.10.2025 -
10.10.2025

 **Ort**
Beilngries

 **Preis**
1.690,00 €

 **Dozent(en)**
Tobias Kugler
Robert Bruckmann
Torsten Rübensaal
Harald Zohner

 **Ansprechpartner**
Christian Schmidtner
08461/650-1337
christian.schmidtner@abg-bayern.de
Ute Beck
08461/650-1358
ute.beck@abg-bayern.de

Buchen