

OpRisk-Management

Praxiserprobte Methoden in der Messung und Steuerung operationeller Risiken

www.exbase.de

Ihr Update im operationellen Risiko!

Erfahren Sie an nur einem Tag, wie Sie nach dem aktuellen Stand der aufsichtlichen Anforderungen bei der Messung, Steuerung und dem Reporting operationeller Risiken vorgehen können.

Themenschwerpunkte auf einen Blick

- Definition und Systematisierung von operationellen Risiken
- Aufbau und Pflege einer Verlustdatenbank
- OpRisk-Strategie: Risikoappetit und Risikotoleranz
- Effiziente Prozesse, Methoden und Modellansätze in der Steuerung operationeller Risiken
- Modelle zur Bestimmung der Verlusthöhe und -häufigkeit (inkl. methodische Gestaltungsspielräume)
- Neuer Standardansatz für regulatorische Eigenmittel zur Eigenkapitalunterlegung (BCBS291, 2014)

Ihr Seminarleiter



Professor Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University

SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Inhouse-Seminar erfahren Sie, wie Sie die aufsichtlichen Anforderungen an operationelle Risiken meistern und Ihr OpRisk-Management optimieren können. Schwerpunktmäßig werden der Aufbau einer Verlustdatenbank, das strategische OpRisk-Management sowie praxiserprobte Methoden in der Steuerung, Verlustmodellierung und im Reporting operationeller Risiken behandelt. Dabei werden sowohl die überarbeiteten Grundsätze der operationellen Risiken aus dem Jahre 2011 als auch die Neuerungen in den Standardansätzen zur Kapitalunterlegung aus dem Jahre 2014 besprochen.

THEMEN DES SEMINARTAGES

Systematisierung und Abgrenzung der operationellen Risiken

- Systematisierung der operationellen Risiken
- Abgrenzung gegenüber anderen Risikoarten
- Minimumstruktur von Verlustdatenbanken: Geschäftseinheit x Ereignis x Verlustart
- Messung versus Steuerung

Aufbau und Pflege einer Verlustdatenbank

- Interne Verluste
- Externe Verluste
- Geschäftsmodell und interne Kontrollfaktoren
- Szenarioanalyse

Integrale Bestandteile zur Steuerung: Operatives Modell operationeller Risiken

- Prinzipien für operationelle Risiken (BCBS195, 2011)
- OpRisk-Strategie und Risikoappetit definieren
- Überschneidungsfreie Verantwortlichkeiten festlegen

WEITERE INHOUSE-SEMINARE IM BEREICH REGULIERUNG

Zinsänderungsrisiken im Bankbuch

Das Zinsänderungsrisiko im Fokus der Aufsicht

Liquiditätsmanagement unter CRR

Herausforderungen bei der Steuerung von LCR und NSFR

Die SREP-Leitlinie der EBA

Können Sie das noch stemmen?

Fundamental Review of the Trading Book

Regulierung der Marktpreisrisiken in Banken

IHR SEMINARLEITER



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Assistant Professor für Finance an der Aarhus University. Er verfügt über langjährige Erfahrung in der Risikomanagementberatung von Banken in Europa, im Nahen Osten sowie in Südafrika. Seine Projekterfahrung reicht im Bereich Liquiditätsrisiko von der Modellierung der Zahlungsströme einzelner Instrumente bis hin zu einem integrierten Liquiditätsstresstest, im Marktrisiko vom Derivatepricing bis zum Setzen von Marktpreislimiten sowie in der Kapitalsteuerung von statischer bis hin zu dynamischer Kapitalallokation.

- Effiziente Prozesse entwerfen und dokumentieren
- Methodik und Modellansätze
- Systemunterstützung

«Fit for Purpose» – Verlustmodellierung

- Anforderungen erfüllen und methodische Gestaltungsspielräume nutzen
- Modellierung der Verlusthäufigkeit: Poissonverteilung
- Modellierung der Verlusthöhe: LogNormal-Verteilung, Exponentialverteilung, Beta-Verteilung, Pareto-Verteilung
- Risikoreduzierende Maßnahmen

Kapitalunterlegung

- Alter und neuer Standardansatz für regulatorische Eigenmittel (BCBS291, 2014)
- Zusammensetzung und Berechnung des Geschäftsindicators
- Fortgeschrittene Messmethoden (AMA): Methodik, Kosten- und Nutzenanalyse

WER SOLLTE TEILNEHMEN?

Dieses Inhouse-Seminar richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus Banken und Sparkassen, Beratungsunternehmen und Aufsichtsbehörden mit den folgenden Schwerpunkten:

- Risikosteuerung (Operationelle Risiken)
- Risikocontrolling
- Interne Revision
- (Regulatory) Compliance

GERNE NEHMEN WIR THEMATISCHE ANPASSUNGEN VOR UND GEWICHTEN DIE INHALTE DES SEMINARS NACH IHREM BEDARF.

KONTAKT

Sven Wiessner
Inhaber Exbase
Telefon: +49 (0)7531 922 82 33
E-Mail: sven.wiessner@exbase.de