

Kritische Würdigung der künftigen IRRBB-/ CSRBB-Leitlinien sowie der Regelungen zu aufsichtlichen Ausreißertests und (vereinfachten) Standardansätzen!



# IRRBB & CSRBB: Zinsänderungsrisiken im Spannungsfeld neuer Vorgaben

Handlungsbedarf bei (vereinfachtem) IRRBB-Standardansatz • Anforderungen an Risikomessung (inkl. CSRBB) • barwertiger/periodischer „Ausreißertest“ • Offenlegungspflichten

- Bewusstes Eingehen von **Zinsänderungsrisiken im Bankbuch** zur Erzielung von **Strukturbeiträgen** als wesentlicher Bestandteil des **Geschäftsmodells** – Inwieweit ist eine hohe Auslastung des Zinsrisikokoeffizienten durch Aufbau von **Fristentransformationspositionen** sinnvoll?
- Kritische Würdigung der neuen IRRBB-/ CSRBB-Leitlinien sowie Regelungen zu vereinfachten Standardansätzen und aufsichtlichen Ausreißertests – Was kommt auf deutsche Banken zu?
- Standardansatz zur Quantifizierung des barwertigen und periodischen **Risikos** anhand eines **Praxisbeispiels**: Voraussetzungen für die Nutzung der vereinfachten Methode • Ausgestaltung des Standardansatzes für die periodische Perspektive
- Barwertiger und periodischer Ausreißertest – was ist ein periodisches „Ausreißer-Kriterium“? • worauf ist bei Modell- und Parameterannahmen zur Messung des Barwertverlustes bzw. Zinsüberschusses zu achten?
- Mindestanforderungen an die Risikomessung/-systeme zur Ermittlung, Bewertung, Steuerung und Eindämmung des Credit-Spread-Risikos im Bankbuch (CSRBB) – grundsätzliche (methodische) Vorgehensweise
- Auswirkungen des neuen IRRBB-Meldewesens auf die Gesamtbanksteuerung: Lieferung periodischer und barwertiger quantitativer Daten • Offenlegung qualitativer Modell- und Parameterannahmen • Informationen über Eckpfeiler und Zinsrisikostrategie • vereinfachte Meldung für SNCI-Institute
- Auswirkungen der IRRBB-/ CSRBB-Neuregelungen auf künftige Ermittlung des SREP-Kapitalzuschlags

(dazwischen 15 min. Pause)

14:00 - 17:00 Uhr

## Mag. Stefan Millinger

Bereichsleitung Risikomanagement  
Bankhaus Carl Spängler & Co.  
Aktiengesellschaft

Seit 2015 als Bereichsleiter verantwortlich für Risikomanagement und Gesamtbanksteuerung (u.a. Neuausrichtung der Risikotragfähigkeitskonzepte).

## Tim-Oliver Engelke

Leiter Risikocontrolling  
Kreissparkasse Düsseldorf

Vormals Spezialist im Controlling der Abteilung Finanzmanagement der Sparda-Bank Hessen eG sowie davor Referent für Gesamtbanksteuerung und Bankenaufsichtsrecht beim Verband der Sparda-Banken. Autor von Fachpublikationen.

# IRRBB & CSRBB: Zinsänderungsrisiken im Spannungsfeld neuer Vorgaben

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

**IRRBB & CSRBB: Zinsänderungsrisiken im Spannungsfeld neuer Vorgaben**  
02.07.2024 (SE2407008)

399,00 €\*

| Preise für TreuePlus Kunden |          |
|-----------------------------|----------|
| Treue PLUS 15               | 339,15 € |
| Treue PLUS 20               | 319,20 € |
| Treue PLUS 25               | 299,25 € |

Wenn Sie eine individuelle Beratung zum Thema benötigen, unterstützen wir Sie gerne, klicken Sie hier: <https://www.fch-gruppe.de/consult>

Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen.

Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

Ich kann nicht am Seminar teilnehmen und bestelle deshalb die Seminarunterlagen als PDF zu den oben angekreuzten Seminaren (150,00 € \*\*\* je Seminardokumentation)

Anmelden / Bestellen

|                                 |                      |
|---------------------------------|----------------------|
| Name:                           | <input type="text"/> |
| Vorname:                        | <input type="text"/> |
| Position:                       | <input type="text"/> |
| Abteilung:                      | <input type="text"/> |
| Firma:                          | <input type="text"/> |
| Straße:                         | <input type="text"/> |
| PLZ/Ort:                        | <input type="text"/> |
| Tel.:                           | <input type="text"/> |
| Fax:                            | <input type="text"/> |
| E-Mail:                         | <input type="text"/> |
| Rechnung an:<br>(Name, Vorname) | <input type="text"/> |
| (Abteilung)                     | <input type="text"/> |
| E-Mail:                         | <input type="text"/> |
| Bemerkungen:                    | <input type="text"/> |

Das Management von Zinsänderungsrisiken im Bankbuch ist einer Vielzahl an regulatorischen Neuregelungen (IRRBB) ausgesetzt. Neben Säule-2-Anforderungen an Risikomethoden, interne Governance, strategische Eckpfeiler und IT-Infrastruktur der Institute sind erweiterte Offenlegungsanforderungen und ein aufsichtsrechtlicher Standardansatz für die barwertige Perspektive auf der Basis der [CRR II](#) und [CRD V](#) zu erfüllen. Dabei verlangen die Herausforderungen methodische und konzeptionelle Anpassungen, wie die Einbindung eines periodischen Ausreißertests in die integrierte Zinsbuchsteuerung, Aufbau von Methoden, Berichtslinien und Governance unter Berücksichtigung barwertiger und periodischer Credit-Spreads-Risiken im Bankbuch (CSRBB) sowie die Erweiterung der Offenlegungsanforderungen um periodische Risikomaße und qualitative Informationen.

02.07.2024 14:00 bis 17:00 Uhr

Der Zugang zum Seminar erfolgt über Ihren persönlichen Nutzerbereich in „MeinFCH“. Informationen zum Zugang und eine Anleitung erhalten Sie spätestens eine Woche vor dem Seminar. Ihre Teilnahmebestätigung und die Seminardokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei zeitgleicher Anmeldung einen Rabatt von **20%**.

Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung Ihre Anmeldebestätigung/Rechnung. Bitte überweisen Sie den Rechnungsbetrag innerhalb von 30 Tagen nach Zugang der Rechnung.

Eine Stornierung Ihrer Anmeldung ist nicht möglich. Eine kostenfreie Vertretung durch Ersatzteilnehmer beim gebuchten Termin dagegen schon. Der Name des Ersatzteilnehmers muss dem Veranstalter jedoch spätestens vor Seminarbeginn mitgeteilt werden. Wir weisen darauf hin, dass „Teilnahmen“ von anderen als den gebuchten Teilnehmern nicht gestattet sind und Schadensersatzansprüche des Veranstalters auslösen. Filmmitschnitt

Bei Absage durch den Veranstalter wird das volle Seminarentgelt erstattet. Darüber hinaus bestehen keine Ansprüche. Änderungen des Programms aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

**Durch die Teilnahme am Seminar erhalten Sie 4 CPE-Punkte als Weiterbildungsnachweis für Ihre Zertifizierung**

\* zzgl. 19 % MwSt. \*\* inkl. 7 % MwSt. \*\*\* zzgl. 7 % MwSt.

## Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die FCH AG und ihre Dienstleister (z. B. Lettershop) verwenden Ihre personenbezogenen Daten für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen ausgewählte Fach- und Produktinformationen per Post zukommen zu lassen. Sie können der Verwendung Ihrer Daten jederzeit durch eine Mitteilung per Post, E-Mail oder Telefon widersprechen.

Senden Sie mir bitte Fach- und Produktinformationen sowie die Banken-Times SPEZIAL für meinen Fachbereich kostenfrei an meine angegebene E-Mail Adresse (Abbestellung jederzeit möglich).

**Senden Sie uns Ihre Bestellung per Mail an:**  
[info@fch-gruppe.de](mailto:info@fch-gruppe.de)

**oder schriftlich an:**

FCH AG  
Im Bosseldorn 30, 69126 Heidelberg  
Fax: +49 6221 99898-99

**Weitere Informationen erhalten Sie unter:**

+49 6221 99898-0  
oder unter [www.FCH-Gruppe.de](http://www.FCH-Gruppe.de)

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen