

## Seminar Markt- und Zinsänderungsrisiko


10. Februar 2025 | Renaissance Wien Hotel


- ✓ Potenzielle Verluste mit effektivem Marktrisikomanagement minimieren
- ✓ Neue IRRBB Supervisory Meldung ab 09/2024
- ✓ Credit-Spread-Sensibilität: Identifikation von Produkten
- ✓ Zuverlässige Risikomessung: Value at Risk, Backtesting und Stresstesting für eine fundierte Entscheidungsfindung

Marktpraxis  
österreichischer  
Banken

### Markt- & Zinsänderungsrisiko

IRRBB, CSRBB & Marktrisiko im  
Handelsbuch kompakt an einem Tag

 10. Februar 2025

 Renaissance Wien Hotel, Wien

 [www.imh.at/zinsaenderung](http://www.imh.at/zinsaenderung)

Ihr persönlicher Anmeldecode:

23258WWW

## IRRBB, CSRBB & Marktrisiko im Handelsbuch kompakt an einem Tag

In unserem Seminar über Markt- und Zinsänderungsrisiko bieten wir Ihnen kompakte Informationen zu den Themen IRRBB (Interest Rate Risk in the Banking Book), CSRBB (Credit Spread Risk in the Banking Book) und Marktrisiko im Handelsbuch. An nur einem Tag erhalten Sie einen umfassenden Überblick über die wichtigsten Aspekte dieser Risiken und lernen, wie Sie diese effektiv managen können. Unsere Experten werden Ihnen praxisnahe Beispiele und Fallstudien präsentieren, um Ihnen das nötige Wissen und die Fähigkeiten zu vermitteln, um die Risiken in Ihrem Unternehmen erfolgreich zu identifizieren, zu bewerten und zu steuern.



### Ihre Seminarinhalte:

09:00 – 17:30 Uhr

09:00 – 13:15 Uhr

#### Zinsänderungsrisiko im Bankbuch – IRRBB

- Überblick Risikoarten & Abgrenzung Marktrisiko zu anderen Risikoarten
- Risikoarten Marktrisiko (FX Risiko, Aktienrisiko etc)
- Unterschiedliche Risikounterarten IRRBB (Risikounterarten, Barwertige Sicht vs Periodische Sicht)
- Barwertige Sicht (EVE)
- EVE Berechnung & Methodik
- EVE SOT (Outlier Test)
- Andere Barwertige Berechnungen (PVBP, BP01)
- Periodische Sicht (NII)
- NII Berechnung & Methodik
- NII SOT (Outlier Test)
- Auswirkungen Bilanzstruktur
- NII und Earnings Sicht (inkl Bewertungseffekte)
- Zinsbuch-VaR für ICAAP
- Überblick
- Unterschiedliche Methoden
- Regulatorische IRRBB Meldung
- Bisherige nationale IRRBB Meldung (Ziri)
- Neuerungen und neue IRRBB Supervisory Meldung ab 09/2024



#### Benedikt Schultes

Group Liquidity and Market Risk Management,  
Erste Group Bank AG

13:15 – 14:15 Uhr Mittagspause

*Das Seminar bietet eine große Themenvielfalt. Die genaue Schwerpunktsetzung erfolgt vor Ort und orientiert sich an den Bedürfnissen der anwesenden Teilnehmenden.*

#### 5 Gründe an dieser Veranstaltung teilzunehmen:

- ✓ Umfassende Risikoanalyse: Identifikation und Bewertung verschiedener Marktrisiken und Zinsänderungsrisiken
- ✓ Aktuelles Wissen: Neue Entwicklungen und Neuerungen im Bereich des Zinsänderungsrisikos
- ✓ Fachliche Expertise: Fundierte Informationen zur Fundamental Review of the Trading Book (FRTB)
- ✓ Umfassender Überblick über das Zinsänderungsrisiko im Bankbuch (IRRBB)
- ✓ Erkennung von Credit-Spread-sensitiven Produkten für gezielte Risikosteuerung



14:15 – 15:45 Uhr

#### Credit Spread Risk in the Banking Book – CSRBB

- Regulatorische Grundlagen – Anforderungen an CSRBB durch die EBA
  - Abgrenzung zu IRRBB – Gemeinsamkeiten und Unterschiede
  - Scoping: welche Produkte werden üblicherweise als Credit-Spread-sensitiv angesehen?
  - Quantifizierung: welche Rahmenbedingungen gibt die EBA GL vor?
- Marktpraxis: Einblick in die Umsetzung österreichischer Banken



#### Stephan Egger

Senior Manager Financial Services,  
KPMG Advisory GmbH

16:00 – 17:30 Uhr

#### Marktrisiko im Handelsbuch

- Regulatorische Rahmenbedingungen
  - CRR III
  - Trennung Bankbuch – Handelsbuch
  - Trading Desks
  - Risikotransfer
- Risikoarten im Handelsbuch
- Risikomessung und Limitierung
- Eigenmittelunterlegung im Handelsbuch
- Value at Risk, Backtesting und Stresstesting
- Fundamental review of the trading book – FRTB



#### Gerald Seiner

Group Liquidity and Market Risk Management,  
Erste Group Bank AG

## ANMELDUNG: [www.imh.at/zinsaenderung](http://www.imh.at/zinsaenderung)

**Teilnahmegebühr** (exkl. 20 % USt.)

Einschließlich Mittagessen, Getränken und digitaler Unterlagen im Login-Bereich

bis 01.11.

€ 1.495,-

bis 17.01.

€ 1.595,-

bis 10.02.

€ 1.695,-



KONFERENZEN  
SEMINARE

Wissen, das bewegt

**% Attraktive Rabatte ab der 2. Teilnahme!**

**Bringen Sie Ihre Kolleginnen und Kollegen mit!**

**10% RABATT** für die 2. Teilnahme

**30% RABATT** für die 3. Teilnahme und alle weiteren

Nicht mit anderen Rabatten kombinierbar.

Haben Sie Fragen? Ich bin gerne für Sie da:



#### Aynur Yildirim

Leitung Customer Service & Datenbank

Tel.: +43 (0)1 891 59 – 0

E-Mail: [anmeldung@imh.at](mailto:anmeldung@imh.at)

Inhaltliche Konzeption:



#### Nkolina Vujanovic

Conference Manager

Tel.: +43 (0)1 891 59 – 612

E-Mail: [nikolina.vujanovic@imh.at](mailto:nikolina.vujanovic@imh.at)