

Identifizierung von und Umgang mit Modellrisiken

Zielgruppe

Fach- und Führungskräfte aus Treasury, Risikocontrolling und Bankcontrolling, Revision, Prüfungsgesellschaften und Verbänden

Ihr Nutzen

Das Seminar erläutert die wesentlichen Modellrisiken samt aufsichtsrechtlichen Anforderungen und beleuchtet die Entstehung von Modellrisiken in einem geänderten Marktumfeld (z. B. Negativzins-Phase).

Seminarinhalt

- Aufsichtsrechtliche Rahmenbedingungen
- Methodische Grundlagen
- Qualitative versus quantitative Sicht auf ein Modell
- Anforderungen an die Parametrisierung
- Gültigkeitsbereich von Modellen
- Checkliste zur Validierung von Modellannahmen
- Exemplarische Modellrisiken einer Muster-Retailbank

Referenten



Rainer Alfes ist Diplom-Mathematiker und bei msgGillardon spezialisiert auf Asset-Liability-Management sowie Steuerung der Marktpreis- und Liquiditätsrisiken. Zu seinen Aufgaben zählen Beratungsprojekte, Akquisen und produktstrategische Themen. Er hat langjährige Erfahrung in der Konzeption von Risikomanagementsystemen, der Abbildung von Treasury-Prozessen, ist Autor von Fachartikeln sowie Referent von Seminaren.



Peter Jacob ist Mathematiker und berät bei msgGillardon Kreditinstitute in den Themenschwerpunkten Marktpreisrisiken, Risikosteuerung, Optionspreismodelle und die Bewertung und Steuerung impliziter Optionen. Er verfügt über langjährige und umfangreiche Erfahrung in der Analyse und Auswertung finanzmathematischer Fragestellungen sowie als Referent von Fachseminaren.