

# Zinsrisikomanagement

Zinsrisiken im Bankbuch aufsichtskonform messen und steuern

## DIE THEMEN

- Baseler Standards und EBA-Leitlinien zu IRRBB
- BaFin-Rundschreiben aus 2018 und 2019
- IRRBB in CRR II/CRD V
- Messung des Zinsrisikos/Abbildung diverser Produkttypen
- Praktische Implementierung und Limitierung der EBA-Leitlinie zu IRRBB
- Bank- und Handelsbuchsteuerung in Einklang bringen

Die EBA-Leitlinien sind  
bereits zum 30.06.2019  
zu beachten

## IHRE REFERENTEN



**Holger Thiele**  
Asset Liability Management,  
Group Treasury,  
Commerzbank AG,  
Frankfurt am Main



**Kamil Pliszka**  
Bundesbankdirektor, Zentralbereich  
Banken und Finanzaufsicht,  
Deutsche Bundesbank,  
Frankfurt am Main

## Ihr Programm im Überblick

### Zinsrisikosteuerung: Umsetzung und Erfahrungen

- Messung des Zinsrisikos
- Abbildung verschiedener Produkttypen
- Geforderte verbesserte Modellierung anlagebuchspezifischer Produkte
- Konzept des Zinsrisiko-Transferpricings
- Zinsrisiko im Bankbuch (IRRBB) - Umsetzung regulatorischer Erfordernisse
- Praktische Implementierung und Limitierung der EBA-Leitlinie zu IRRBB
- Credit-Spread-Risiko im Bankbuch
- IRRBB und FRTB: Bank- und Handelsbuchsteuerung in Einklang bringen
- IRRBB und IFRS9: Steuerung unter bilanziellen Restriktionen

### Aktuelle regulatorische Entwicklungen

- Baseler Standards zu Interest Rate Risk in the Banking Book (IRRBB)
- EBA-Leitlinien zu IRRBB
- BaFin-Rundschreiben aus 2018 und 2019
- IRRBB in CRR II/CRD V

### Kombinationsmöglichkeiten

z.B. mit "Neuausrichtung der RTF" am 26.11.19 und/oder "Liquiditätsrisikomanagement" am 27.11.19:  
2 Seminartage: 1.580,- €, 3 Seminartage: 1.990,- €

### Ziel des Seminars

Mit den Baseler Standards zu "Interest Rate Risk in the Banking Book (IRRBB)", den EBA-Leitlinien und den neuen Anforderungen in der CRR II/CRD V, stellt die Aufsicht die Banken, besonders in der aktuellen Niedrigzinssituation, vor neue Herausforderungen. Dabei sind die EBA-Leitlinien bereits zum 30.06.19 zu beachten. Zudem hat die BaFin kürzlich ihr Rundschreiben zu IRRBB überarbeitet. Erfahren Sie von unseren Experten aus Aufsicht und Treasury-Praxis die Inhalte und Interpretation der neuen Anforderungen, die insbesondere das Risikomanagement, die Offenlegung und den Messansatz betreffen. Lernen Sie, Zinsänderungsrisiken sowohl aus barwertiger als auch aus Ertragssicht aufsichtskonform zu identifizieren, zu messen, zu validieren, zu steuern und offen zu legen.

### Teilnehmerkreis

Das Seminar richtet sich an alle, die mit der Umsetzung der neuen und aktuellen Zinsrisiko-Regulierung sowie dem Messen, Steuern, Controlling und Offenlegen von Zinsrisiken konfrontiert werden.

---

## MEHR INFORMATIONEN

**www.forum-institut.de**  
**Webcode 1911363**  
**service@forum-institut.de**  
**Tel. +49 6221 500-500**  
**Fax +49 6221 500-555**

### Gebühr:

€ 990,00 (+ gesetzl. MwSt.)

### Veranstaltungsort:

Montag, 25. November 2019 in Frankfurt,  
10:00 - 17:30 Uhr  
Le Méridien Parkhotel



---

## AGB

Es gelten unsere Allgemeinen Geschäftsbedingungen (Stand: 01.01.2016), die wir auf Wunsch jederzeit übersenden und die im Internet unter [www.forum-institut.de/agb](http://www.forum-institut.de/agb) eingesehen werden können.

## IHR ANSPRECHPARTNER



### Carmen Fürst-Grüner

Konferenzmanagerin Financial Services  
Tel. +49 6221 500-860  
[c.fuerst-gruener@forum-institut.de](mailto:c.fuerst-gruener@forum-institut.de)