ASPECT ADVISORY
ACADEMY
Your AAA Education

FÜHRUNGSKRÄFTE-AUSBILDUNG | TECHNISCHES SEMINAR

Validierung von Risikomodellen

ZUSAMMENFASSUNG:

Risikomodelle sind ein wesentlicher Bestandteil des Risikomanagements. Allerdings haben Risikomodelle auch eine wichtige (berüchtigte) Rolle in der Finanzkrise gespielt. Das Bewusstsein der Regulierungsbehörden für Risikomodelle, ihre Genauigkeit und Validierung ist gestiegen. Dieser Workshop schafft die Voraussetzungen, indem er Validierung definiert und die Anforderungen an die Prozesse, Methoden und Infrastruktur der Modellvalidierung detailliert darlegt.

ÜBERSICHT ÜBER DIE TAGESORDNUNG:

1-tägiges Seminar:

Validierung von Risikomodellen

WER SOLLTE TEILNEHMEN:

Wir glauben, dass dieses Seminar für Teilnehmer aus folgenden Bereichen am nützlichsten ist:

- Aufsichtsbehörden
- Risikomanagement
- Risikokontrolle
- Interne Revision
- Modellvalidierung

SEMINARFORMAT:

- Dieses Seminar wird auf Englisch abgehalten.
- Diese Sitzung wird über Microsoft Teams abgehalten. Nach Abschluss Ihrer Anmeldung erhalten Sie einen Link zum Meeting.

KURSUNTERLAGEN:

- Die Sitzungen werden aufgezeichnet und können auf Anfrage am Ende des Seminars angefordert werden.
- Die Präsentationsfolien der Trainer können auf Anfrage am Ende des Seminars angefordert werden.

ZERTIFIKAT:

- Die Teilnehmer erhalten nach Abschluss des Seminars Zertifikate per E-Mail.

Haben Sie eine Frage? Senden Sie uns eine E-Mail an: aaa.aspectadvisory.eu

https://www.aspectadvisory.eu/academy/

ASPECT ADVISORY ACADEMY
Your AAA Education

FÜHRUNGSKRÄFTE-AUSBILDUNG | TECHNISCHES SEMINAR

Validierung von Risikomodellen

BEISPIELEINTEILUNG

TAG 1

	Validierung von Risikomodellen
09:00 10:30	**1. Risikomodelle und Modellrisiken** 1.1 Beispiele für Modellrisiken? 1.2 Definition und Abgrenzung von Modellrisiken 1.3 Regulatorische Anforderungen an das Management von Modellrisiken (inkl. MaRisk Novelle 7 ab Sept. 2022) 1.4 Die Grundlage des ICAAP: Risiko- und Modellinventar 1.5 Validierung: Bewertung der Angemessenheit von (Risiko-)Modellen
	Kaffeepause am Morgen
10:45 12:15	**2. Umfassende Modellvalidierung** 2.1 Erwartungen der Vorgesetzten 2.2 Der Validierungsprozess 2.3 Qualitative Validierung 2.4 Quantitative Validierung 2.5 Validierungsbericht 2.6 Interpretation und Konsequenzen der Validierungsergebnisse

Bitte beachten Sie:
Dies ist ein Beispielplan und die Sitzungsthemen dienen nur zur Veranschaulichung und können sich ändern.

ASPECT ADVISORY ACADEMY
Your AAA Education

FÜHRUNGSKRÄFTE-AUSBILDUNG | TECHNISCHES SEMINAR

Validierung von Risikomodellen

BEISPIELEINTEILUNG

TAG 1

Mittagspause

13:30 – 15:00

3. Validierung eines Marktrisikomodells

3.1 Qualitative Validierung

- Konzept und mathematische Korrektheit
- Systeme und Daten
- Prozess und Governance
- Benutzerfreundlichkeit

3.2 Quantitative Validierung

- Backtesting: Anzahl der Ausreißer
- Stabilität: über die Zeit/über Portfolios hinweg

Kaffeepause am Nachmittag

15:15 – 17:00

4. Validierung eines Kreditrisikomodells

4.1 Qualitative Validierung

- Konzept und mathematische Korrektheit
- Systeme und Daten
- Prozess und Governance
- Benutzerfreundlichkeit

4.2 Quantitative Validierung

- Diskriminierungskraft
- Kalibrierung
- Stabilität: über die Zeit/über Portfolios hinweg

5. Validierung eines AMA-Modells für operationelle Risiken

(alternativ zum Kredit- oder Marktrisikomodell)

6. Validierung eines Geschäftsrisikomodells

(alternativ zum Kredit- oder Marktrisikomodell)

Ende der Sitzung

Bitte beachten Sie:
Dies ist ein Beispielplan und die Sitzungsthemen dienen nur zur Veranschaulichung und können sich ändern.