

# Basisseminar Zinsänderungsrisiken

## Zielgruppe

Fach- und Führungskräfte sowie „Einsteiger“ aus ALM beziehungsweise APM, Treasury, Risikocontrolling, Bankcontrolling, Revision, interner und externer Prüfung sowie Rechenzentralen und Verbänden

## Ihr Nutzen

Die Teilnehmer/-innen erhalten einen kompakten und gleichzeitig fundierten Überblick zum Basiswissen im Themengebiet der Messung und Steuerung von strategischen Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch (IRRBB).

## Seminarinhalt

Die Niedrigzinsphase sowie aufsichtsrechtliche Bedingungen (MaRisk, EBA, BCBS) erhöhen die Bedeutung des Zinsänderungsrisikos im Bankbuch (IRRBB). Im Seminar liegt der Fokus auf Zinsänderungsrisiken aus wertorientierter und periodischer Sicht im Normal- und Stress-Case sowie sich daraus ergebenden Herausforderungen. Neben der Vermittlung von Fachwissen werden eine Fallstudie und Fragen zur praktischen Umsetzung diskutiert (z. B. Ausschusssitzung).

## 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.



**Dr. Sven Heumann** ist promovierter Mathematiker und bei msgGillardon in der fachlichen Weiterentwicklung der Software, in der Fachberatung und als Referent tätig. Seine Schwerpunktthemen sind Marktpreisrisikosteuerung, Liquiditätsrisikosteuerung und Gesamtbankplanung – mit Fokus auf einen kennzahlenorientierten Ansatz – sowie Kapitalplanungsprozess und Liquiditätskostenverrechnungssystem.



**Klaus Stechmeyer-Emden** ist Volkswirt und bei msgGillardon auf die methodische Beratung, Konzeption und Projektleitung spezialisiert. Er berät Kreditinstitute in seinen Kernthemen strategisches Zinsbuchmanagement, Messung und Steuerung von Marktpreis- und Liquiditätsrisiken sowie hierzu passenden aufsichtsrechtlichen Fragestellungen und ist erfahrener Referent sowie Autor von Fachpublikationen.