

vdpPfandbriefAkademie

vdp-Erfahrungsaustausch Zinsänderungsrisiko im Anlagebuch – zweitägiger Online-Workshop (kostenfrei)

Online-Workshop – den Link zum virtuellen Raum, erhalten Sie wenige Tage vor Veranstaltungsbeginn

11. & 12. November 2020, 09:00 – 13:00 Uhr

Moderator:

- Dr. Uwe Gaumert (Verband deutscher Pfandbriefbanken e.V. (vdp))
- Dr. Tino Schulz (d-fine)

Referenten:

- Dr. Uwe Gaumert (Verband deutscher Pfandbriefbanken e.V. (vdp))
- Stephan Gliem (Abteilungsleiter Markt- und Liquiditätsrisikocontrolling,
Landesbank Berlin - Berliner Sparkasse)
- Thomas Hornung (Direktor, Abteilungsleiter Marktpreis- und Liquiditätsrisiko,
NRW.BANK)
- Ulrike Steffan (Abteilungsleiterin Marktpreisrisikocontrolling, Bausparkasse
Schwäbisch Hall)

Kostenfreier Online-Workshop der vdpPfandbriefAkademie mit Adobe Connect an zwei Vormittagen am 11. und 12. November 2020. Der Online-Workshop soll primär dem Austausch der Institute auf Basis von Praxisbeispielen dienen. Da die Beispiele als Startpunkt für die Diskussion gedacht sind, sollten sie nicht mehr als 30 Minuten in Anspruch nehmen.

Tag 1 – 11. November 2020

08:45 – 09:00 Online Registrierung & Begrüßung

09:00 – 10:30 Einleitung - Regulatorisches Update IRRBB (Dr. Uwe Gaumert)

- Risikoreduzierungsgesetz (RiG)
- Diskussionen zum RiG im Fachgremium IRRBB
- Erwartete Entwicklungen durch EBA-Tätigkeit
- 3. Änderungs-VO zur FinaRisikoV

10:30 – 11:00 Pause

11:00 – 12:30 Steuerungskreise EVE und NII in der Praxis (Ulrike Steffan)

- ICAAP-Perspektiven in der BSH
- IRRBB-Management in der ökonomischen Perspektive
- IRRBB in der normativen Perspektive
- Verbindung der beiden Steuerungskreise

Tag 2 – 12. November 2020

08:45 – 09:00 Online Registrierung & Begrüßung

09:00 – 10:30 Behandlung von BGB-Kündigungsrechten in der Praxis (Stephan Gliem)

- Charakteristika des eigenen Ansatzes (Optionsmodellierung, Risikomessung)
- Integration in das Risikomanagement (z.B. Hedging, Limitierung, Reporting, ICAAP)
- Besondere Herausforderungen

10:30 – 11:00 Pause

11:00 – 12:30 Umgang mit Credit Spread Risiken im Rahmen der IRRBB-Modellierung
(Thomas Hornung)

- Scope: Welche Positionen sollten berücksichtigt werden?
- Eigenständige Risikokategorie im ICAAP?, Abgrenzung zu Ausfallrisiken
- Pros und Cons integrierter bzw. getrennter Mess- und Steuerungsansatz
- EVE- und NII-Perspektive

12:30 – 13:00 Round Table: Erwartete Auswirkungen der COVID-19-Pandemie