

vdpPfandbriefAkademie

Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch – Herausforderungen durch die neue EBA-Regulierung

09. November 2022 von 09:00 Uhr bis 13:00 Uhr

Online-Seminar via Cisco Webex – den Link zum virtuellen Raum erhalten Sie wenige Tage vor der Veranstaltung

Moderator:

- Dr. Uwe Gaumert (Verband deutscher Pfandbriefbanken e.V.)

Referenten:

- Thomas Springmann (Deutsche Bundesbank, Zentrale Frankfurt am Main, Bankgeschäftliche Prüfungen und Umsetzung internationaler Standards (B 301))
- Stephan Gliem (Landesbank Berlin AG/Berliner Sparkasse, Abteilungsleiter Markt- und Liquiditätsrisikocontrolling)
- Rainer Alfes (Executive Business Consultant Banksteuerung msg GillardonBSM AG, Ismaning/München)

08:45 – 09:00 Online Registrierung & Begrüßung

09:00 – 10:00 Überblick über die neuen Vorgaben der EBA zu IRRBB –
Thomas Springmann

- Überblick über die Neuerungen
- Interne Ansätze (IRRBB und CSRBB)
- Supervisory Outlier Test (SOT)
- Standardansätze

10:00 – 11:00 Würdigung der neuen IRRBB-Regulierung aus Sicht eines Instituts -
Stephan Gliem

- Größte Herausforderung im Überblick
- Neue Vorgaben zu CSRBB (EVE und NII)
- Umsetzung der neuen SOT-Vorgaben

11:00 – 11:30 Pause

11:30 – 12:30 Implementierungsherausforderungen der neuen IRRBB-Regulierung –
Rainer Alfes

- Überblick über erwartete wichtigste Änderungsbereiche
- Interne Ansätze – IRRBB
- Interne Ansätze - CSRBB
- NII-SOT
- Implementierung der Standardansätze?
- Unterstützung durch msg GillardonBSM

12:30 – 13:00 Abschlussdiskussion – Panel der drei Referenten