

WORKSHOP STRESSTEST  
14. MÄRZ 2019

ECOS | FRANKFURT

1 PLUS i  
WORKSHOPS

## STRESSTESTING KOMPAKT: LSI-STRESSTEST, EBA- UND MARISK, STRESS IM RTF/ICAAP-MODELL

### THEMA

Stresstests bleiben eines der Top-Themen der Bankenaufsicht und im Risikomanagement. Mit dem LSI-Stresstest 2019 führen Bundesbank und BaFin für fast alle national beaufsichtigten Institute eine mit dem im letzten Jahr vollendeten EBA-Stresstest vergleichbare Übung durch. Der Nachfolger der Niedrigzinsumfrage (NZU) aus dem Jahr 2017 nähert sich methodisch immer weiter der sehr aufwändigen Stresstestübung für SIs an. Aber auch für interne Stresstests gelten neben den MaRisk ab 2019 neue Anforderungen aus den aktuellen EBA Guidelines. Neben einer Verschärfung der Anforderungen wird auch eine enge Verzahnung mit den neuen RTF-Konzepten erforderlich.

### WORKSHOPZIELE

Im Workshop werden Ihnen die aktuellen Anforderungen und praxisnahe Umsetzungs-ideen nähergebracht. Wir stellen Ihnen den aktuellen LSI-Stresstest und toolbasierte Lösungsideen vor, geben Ihnen einen Überblick über die Anforderungen von EBA und BaFin und präsentieren Ideen dazu, wie die gestresste Risikotragfähigkeitsrechnung aus ökonomischer und normativer Sicht aussehen kann.

Während unserer Veranstaltung bieten wir Ihnen ausreichend Gelegenheit zu Erfahrungsaustausch und Diskussion. Bitte teilen Sie uns zusammen mit Ihrer Anmeldung mit, welche Fragestellungen Sie besonders interessieren. Wir freuen uns auf Ihre Teilnahme und stehen im Vorfeld für Fragen gerne zur Verfügung.

Bitte melden Sie sich gleich an – die Anzahl der Teilnehmer ist leider begrenzt!

### VERANSTALTUNGSORT

ECOS Office Center Frankfurt, Mainzer Landstraße 50, 60325 Frankfurt

INHALTE	<p>Aktuelle Stresstestanforderungen – ein Überblick</p> <p>LSI -Stresstest</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● Übergreifender methodischer Ansatz, Anforderungen und Ergebnisbewertung</li> <li>● Methodik in den Risikoarten, praktische Herausforderungen und Ansätze für die toolbasierte Umsetzung <ul style="list-style-type: none"> <li>● Kreditrisiko</li> <li>● Zinsänderungsrisiko</li> <li>● Marktpreisrisiko</li> <li>● GuV</li> </ul> </li> </ul> <p>Mindestanforderungen an das Risikomanagement (MaRisk) und Stresstest-Guidelines (EBA/GL/2018/04)</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● Übersicht über die Anforderungen und Einordnung der Stresstests</li> <li>● Konzeptionelle Anforderungen und Einbindung in die Banksteuerung</li> <li>● Abgrenzung und Kombination der verschiedenen Stresstestmethoden (historisch, hypothetisch, risikoartenspezifisch und -risikoartenübergreifend)</li> <li>● Umsetzungsimplicationen</li> </ul> <p>Stresstest im ICAAP</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● Überblick über europäische und nationale Anforderungen an die Risikotragfähigkeit (Leitfaden von BaFin und Bundesbank, SSM-Leitfaden) und Einordnung der Stresstests</li> <li>● Stresstests für den ökonomischen Ansatz</li> <li>● Stresstests für den normativen Ansatz: Kapitalgrößen (Säule I) und zusätzliche Kapitalanforderungen (Säule II)</li> <li>● DISKUSSION: Nutzung von aufsichtlichen Stresstests als Aufsatzpunkt für den ICAAP zur Sicherstellung der Solvenz für einen 3-Jahres-Zeitraum und in einem adversen Umfeld</li> </ul>
REFERENTEN	<p>HENNING HEUTER Geschäftsführender Partner bei 1 PLUS i</p> <p>DR. CHRISTIAN STEPANEK Partner bei 1 PLUS i</p>
ABLAUF DER WORKSHOPS	<p>09.45 EINTREFFEN DER TEILNEHMER UND PERSÖNLICHE BEGRÜSSUNG</p> <p>10.15 INHALTE DER OBIGEN AGENDA</p> <p>13.00 MITTAGSPAUSE (CA. 45 MINUTEN)</p> <p>16.45 ABSCHLUSS DES WORKSHOPS</p>

IHRE ANMELDUNG

Anmeldung | Fax 0911 – 56 79 95 55 | Mail [workshops@1plusi.de](mailto:workshops@1plusi.de)

Bitte melden Sie sich frühzeitig für die Veranstaltung an, so dass wir Ihnen eine Teilnahme ermöglichen können. Die Kosten für die Teilnahme betragen 690 EUR pro Person zzgl. MwSt. Darin sind die Workshopunterlagen und die Verpflegung während des Workshops (Kaffeepausen, gemeinsames Mittagessen) inbegriffen. Nach Eingang des ausgefüllten Formulars erhalten Sie eine Bestätigung Ihrer Anmeldung. Bis 4 Wochen vor Veranstaltungstermin können Sie kostenlos stornieren. Nach diesem Zeitpunkt oder für den Fall, dass Sie nicht erscheinen, berechnen wir die gesamte Teilnahmegebühr. Gern aber können Sie sich von einer Kollegin oder einem Kollegen vertreten lassen. Bitte nutzen Sie für die Änderung der Anmeldung oder die Stornierung ebenfalls die genannte Faxnummer.

**Stresstest (14.03.2019)**

Name mit Titel und  
Vorname

---

Unternehmen, Abteilung

---

Rechnungsanschrift

---



---

Telefon

---

Mailadresse

---



---

IHRE FRAGEN

Haben Sie Fragen? Wir unterstützen Sie auch gern bei Ihrer Hotelsuche, wenn Sie es wünschen. Schreiben Sie eine Nachricht oder rufen Sie uns einfach an.

UNSERE KONTAKTDATEN

1 PLUS i GmbH | Postfach 130211 | 90114 Nürnberg  
T 0911 – 56 79 94 99 | F 0911 – 56 79 95 55 | [www.1plusi.de](http://www.1plusi.de)