

[RMK] Risikomanagement in der KVG

Gesetz und Praxis

Seminarinhalte

Im Rahmen des eintägigen Seminars werden den Teilnehmern die Risiken einer Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Gesellschaftsebene und Ebene des Investmentvermögens vermittelt. Die Teilnehmer erhalten einen umfassenden Überblick der gesetzlichen Anforderungen an das Risikomanagement in der KVG und deren Umsetzung in der täglichen Praxis.

Einführung

- Rechtlicher Rahmen
- Begriffe im Risikomanagement
- Organisation Risikomanagement
- Risikosteuerung

Risikomanagement auf Gesellschaftsebene

- EU-Vorgaben: Bewertung und Umsetzung
- Gesetzliche Vorgaben / Derivate V
- Funktionstrennung
- Risikoabdeckungspotenzial der KVG, Gesamtrisikopotenzial
- Interessenskonflikte
- Auslagerungsrisiko
 - Auslagerungsprozesse, Risikoanalyse, Überwachung

Risikomanagement auf Ebene des Investmentvermögens

- EU-Vorgaben: Bewertung und Umsetzung
- Liquiditätsrisikomanagement von Investmentvermögen
 - Liquiditätsrisiken, KaMaRisk, DerivateV
 - Passivseite, Liquiditätsstresstest
- Risikocontrolling, Anlagegrenzprüfung
 - Anlagegrenzen, Marktrisiko (einfacher/qualifizierter Ansatz)

Exkurs

- Meldewesen
- Neue Produkte
- Operationelle Risiken

Zielgruppe

- Mitarbeiter aus den Bereichen Steuerung und Bewertung von Risiken
- Geschäftsführung, Abteilungsleitung

Vorkenntnisse: Grundkenntnisse Investmentfonds

Seminarzeiten: Dauer: 1 Tag
Präsenz: EUR 1.050 (+ MwSt.)
Livestream: EUR 975 (+ MwSt.)
Teilnehmer: maximal 10

Termine: 07. Juni 2021