

Risikomanagement Zertifikatsmodulübersicht

	Kreditrisiko- management	Marktpreisrisiko- management	Liquiditätsrisiko- management	Mittelstand	Non-Financial Risks
Module Grundlagen	Finanzmathematische und statistische Grundlagen des Risikomanagements und Controllings				
		Zins-, Volatilitäts- und Ausfallstrukturkurven			
			Liquiditätsrisiko – Definitionen und regulatorische Vorgaben		
Module Regulatorik	Solvabilitätsanforderungen			Solvabilitätsanforderungen	
	EMIR: Anforderungen an OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Kontrahentenrisiken				
	MaRisk: Schwerpunkt Kreditgeschäft			MaRisk: Schwerpunkt Kreditgeschäft	
		MaRisk: Schwerpunkt Handelsgeschäfte		MaRisk: Schwerpunkt Handelsgeschäfte	
					Non-Financial Risks
Module Produkte			Liquidität – Modellierung und Allokation		
		Zinsderivate		Zinsderivate	
		Optionen		Optionen	
	Derivate und strukturierte Produkte im Kreditgeschäft				
	Kreditderivate			Kreditderivate	
Module Steuerung	Ratingverfahren – Aufbau, Entwicklung und Einsatz				
	Kreditrisikomodelle			Kreditrisikomodelle	
		Value-at-Risk		Value-at-Risk	
			Allgemeine Anforderungen an das Liquiditätsrisiko – Risikomessmethoden		
			Liquiditätstresury im Kontext der Gesamtbanksteuerung		
	Risikotragfähigkeit und Limitkonzeption für die Gesamtbank				
	Stresstests in Banken				
		Mathematische Modelle zur Bewertung von Zins- und Kreditderivaten			
		Foreign Exchange (FX) – Aktives Währungsmanagement			
				Operationelles Risiko	
					Steuerung von Reputationsrisiken
					Business Continuity Management Krisenmanagement