

## [K19-R02] Risikomanagement in der KVG - Gesetz & 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

**Seminar Daten:** Dauer: 1 Tag  
Preis: EUR 1.250 (+ MwSt.)  
Teilnehmer: maximal 10

**Termine:** 24. Juni 2019  
25. November 2019