

## [K18-R01] Risikomanagement in der KVG

### Seminarinhalte

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

#### Einführung

- Geschichtlicher Abriss
- Rechtlicher Rahmen
  - Kapitalanlagegesetzbuch
  - DerivateV, Risikoauslegung BaFin aktuell
  - AIFMD, ESMA Risikoauslegung aktuelle Sicht
- Begriffe im Risikomanagement

#### Risikomanagement auf Gesellschaftsebene

- Gesetzliche Vorgaben
- Funktionstrennung
- Risk Management Policy
- Risikoabdeckungspotenzial der KVG, Gesamtrisikopotenzial
- Interessenskonflikte
- Auslagerungsrisiko
  - Auslagerungsprozesse, Risikoanalyse, Überwachung

#### Risikomanagement auf Fondsebene

- Gesetzliche Vorgaben und Funktionstrennung
- Risikomanagement von Sondervermögen
  - Liquiditätsrisiken, KaMaRisk, DerivateV
  - Passivseite, Liquiditätsstresstest
- Risikocontrolling, Anlagegrenzprüfung
  - Anlagegrenzen, Marktrisiko (einfacher/qualifizierter Ansatz)

#### Meldewesen

#### Neue Produkte

#### Operationelle Risiken

- Schadensdatenbank
- Compliance
- Interne Revision
- Stresstest

#### Zielgruppe

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

**Vorkenntnisse:** Grundlagen Investmentfonds

**Seminardaten:** Dauer: 1 Tag  
Preis: EUR 1.195 (+ MwSt.)  
Teilnehmer: maximal 10

**Termine:** 18. Juni 2018