

# Grundlagen der Risikoinventur

Beurteilung von (wesentlichen) Risiken & Risikotreibern (z. B. ESG)



**Banken-Praxis-Seminar · 3,5 CPE-Punkte**

Mindestanforderungen an eine nachhaltige Risikoinventur!

- **Notwendiger (Mindest-)Umfang der Risikoinventur**
- **Definition der Wesentlichkeitsschwelle**
- **Auswahl der relevanten Risikoarten und Risikokonzentrationen**
- **Ansätze zur Bewertung der Ertrags-, Vermögens- & Liquiditätslage**
- **Auswirkungen der Risikoinventur auf die ökonomische und normative Risikotragfähigkeit und Ableitung pragmatischer Stresstestansätze**
- **Ansätze zur Prüfung der Risikoinventur durch die Interne Revision**

**20** Jahre  
**AKADEMIE  
HEIDELBERG**

## Referent



Thomas von Brasch  
Bereichsleiter  
Unternehmenssteuerung  
Vereinigte Volksbank Raiffeisenbank eG

## Programm

**Thomas von Brasch, Vereinigte Volksbank** · 14:00–17:00 Uhr

### Aktuelle MaRisk- und Aufsichts-Anforderungen an Risikomanagement und Risikotragfähigkeit (RTF)

- Aktuelle aufsichtliche Anforderungen an das Risikomanagement/die Risikoinventur der Institute aus den MaRisk
- Grundzüge der Risikoinventur
- Definition von Wesentlichkeitsschwellen
- Einbindung von Risikoarten und potenziellen Risikokonzentrationen
- Erörterung pragmatischer Bewertungsmethoden und -herangehensweisen
- Einbindungsideen in die Risikotragfähigkeit
- Ableitungsansätze von Stresstests
- Prüfungsansätze für die Interne Revision

## Gute Gründe für Ihre Teilnahme

- Sie erarbeiten sich aktuelles Know-how zu spezifischen Grundlagen der Risikoinventur
- Sie erhalten sofort anwendbare Umsetzungs-Hinweise für Ihre Institut
- Sie klären offene Fragen für Ihren Bereich oder Ihr Institut mit dem Referenten
- Sie erhalten wertvolle Praxistipps im Erfahrungsaustausch mit anderen Praktiker\*innen

## Seminarziel

Die Risikoinventur stellt das Herzstück des Risikomanagements einer Bank dar. Auf Basis der Erkenntnisse aus der Risikoinventur werden alle weiteren Prozesse im Risikomanagement aufgebaut. Entsprechend sind in den regelmäßigen Überprüfungen auch die aktuellen (Markt-)Entwicklungen zu berücksichtigen. Ein zentrales Thema der aktuellen Zeit ist bei all den aufsichtlichen Anforderungen und Interpretationen einen roten Faden zu behalten, der einen hohen Praxisnutzen für die Bank hat.

Im Rahmen dieses Seminars werden der grundlegende Aufbau und die Durchführung der Risikoinventur besprochen. Zudem wird die pragmatische Herangehensweise an die Einbindung aller (wesentlichen) Risiken und Risikotreiber (ESG) in die Risikoinventur erörtert, um Sie bei der aufsichtskonformen Ausgestaltung des Risikoinventur-Prozesses zielgerichtet zu unterstützen.

Im Seminar setzt sich der Referent mit den aktuellen Auslegungs- und Umsetzungsfragen auseinander und gibt wertvolle Praxis-Hinweise und Prüfungs-Tipps zur Risikoinventur sowie deren Prüfung.

## Zielgruppe

Aus der Praxis für die Praxis!

Wir wenden uns insbesondere an die Mitarbeitenden der Bereiche

- Risikomanagement und Risikocontrolling
- Risikotragfähigkeit, Kapitalplanung und Stresstesting
- Gesamtbanksteuerung und Unternehmensstrategie
- Interne Revision und Steuerungsrevision
- Organisation und Gesamtbanksteuerung
- Compliance und Regulatorik
- Governance- und Grundsatzbereiche
- sowie andere interessierte Fachbereiche bzw. Mitglieder des Vorstands und der Geschäftsleitung, externe Prüferinnen und Prüfer und Bankdienstleister

## Unser Referent



### **Thomas von Brasch**

Bereichsleiter Unternehmenssteuerung  
Vereinigte Volksbank Raiffeisenbank eG

*Thomas von Brasch ist Leiter der Risikocontrolling-Funktion in einer Regionalbank. Zuvor war er 10 Jahre im Prüfungsdienst, spezialisiert auf den Bereich Gesamtbanksteuerung, auch als Sonderprüfer gem. §44 KWG für die BaFin tätig. Herr von Brasch hat zudem 15 Jahre lang operativ im Controlling gearbeitet und die Risikocontrolling-Funktion in verschiedenen Banken übernommen.*

# Seminar-Vorschläge

Einbindung von Nachhaltigkeitsrisiken und ESG-Kriterien in Risikosteuerung und Risikoinventur

10. März 2025, Online-Veranstaltung

Risikomanagement im Fokus der Aufsicht

12. März 2025, Online-Veranstaltung

Risikoinventur im Fokus der Aufsicht

24. März 2025, Online-Veranstaltung

Zinsänderungsrisiken & Kreditspread-Risiken im Aufsichts-Fokus

31. März 2025, Online-Veranstaltung

Aufbau eines aufsichtskonformen & reversionssicheren IKS

27./28 März 2025, Online-Veranstaltung

Neue DORA- und Aufsichts-Anforderungen an Notfallmanagement & BCM

31. März 2025, Online-Veranstaltung

Prüfung & Beurteilung von Liquiditäts- & Refinanzierungsrisiken

2. April 2025, Online-Veranstaltung

Zertifizierter Auslagerungs-Manager (MaRisk) & IKT-Dienstleister-Steuerer (DORA)

16.–18. Juli 2025, Online-Veranstaltung

► Diese und weitere Seminar-Angebote finden Sie bei uns online unter [www.akademie-heidelberg.de/online-seminare](http://www.akademie-heidelberg.de/online-seminare)

## Zusätzliche Informationen

Fragen zu diesen Schulungen oder unserem gesamten Seminar-Programm beantworte ich Ihnen sehr gerne.



Björn Wehling

Telefon 06221/65033-44

[b.wehling@akademie-heidelberg.de](mailto:b.wehling@akademie-heidelberg.de)

## Anmeldeformular

### Grundlagen der Risikoinventur

Name \_\_\_\_\_

Vorname \_\_\_\_\_

Position \_\_\_\_\_

Firma \_\_\_\_\_

Straße \_\_\_\_\_

PLZ / Ort \_\_\_\_\_

Tel./Fax \_\_\_\_\_

E-Mail \_\_\_\_\_

Name der Assistenz \_\_\_\_\_

Datum Unterschrift \_\_\_\_\_

Senden Sie Ihre Anmeldung bitte an: [anmeldung@akademie-heidelberg.de](mailto:anmeldung@akademie-heidelberg.de)

#### Termin und Seminarzeiten

Donnerstag, 5. Juni 2025  
14:00–17:00 Uhr  
Online-Zugang ab 13:45 Uhr  
Seminar-Nr. 25 06 BA192 W

#### Teilnahmegebühr

€ 290,- (zzgl. gesetzl. USt)

Die Gebühr beinhaltet die Teilnahme am Online-Seminar sowie die Präsentation als PDF-Datei.

Im Anschluss an das Seminar erhalten Sie ein Zertifikat, das Ihnen die Teilnahme an der Fortbildung bestätigt.

#### Allgemeine Geschäftsbedingungen

Es gelten unsere Allgemeinen Geschäftsbedingungen (Stand: 01.01.2010), die wir Ihnen, wenn gewünscht, gerne zusenden. Diese können Sie jederzeit auch auf unserer Homepage einsehen: [www.akademie-heidelberg.de/agb](http://www.akademie-heidelberg.de/agb)

#### Zum Ablauf

- Vor dem Seminartag erhalten Sie von uns eine E-Mail mit einem Link, über den Sie sich direkt in die Online-Veranstaltung einwählen können.
- Für Ihre Teilnahme ist es nicht notwendig, ein Programm herunterzuladen. Sie können am Seminar direkt per Zoom im Internet-Browser teilnehmen.
- Über Ihr Mikrofon und Ihre Kamera können Sie jederzeit Fragen stellen und mit den Referierenden und weiteren Teilnehmenden diskutieren. Alternativ steht auch ein Chat zur Verfügung.



02.25 / 25 06 BA192

**AH** **AKADEMIE**  
**HEIDELBERG**

**AH Akademie für Fortbildung Heidelberg GmbH**  
Maaßstraße 28 · 69123 Heidelberg  
Telefon 06221/65033-0  
[info@akademie-heidelberg.de](mailto:info@akademie-heidelberg.de)  
[www.akademie-heidelberg.de](http://www.akademie-heidelberg.de)