Sparkassenakademie
Nordrhein-Westfalen



FORTBILDUNGSPROGRAMM 2027

30 Banksteuerung

INHALTSVERZEICHNIS

SEITE

30 Banksteuerung **6**

Tagungen/Praxisdialoge **7**

30.001 Fachtagung Banksteuerung - Regionalveranstaltung Westfalen-Lippe 8

30.002 Fachtagung Banksteuerung und Bankenaufsicht - Regionalveranstaltung Rheinland 10

30.017 Praxisdialog Verlustdatensammlung (VDS) 12

30.019 Praxisdialog zur Steuerung des variablen Geschäfts – Fokus: Festlegung der Mischungsverhältnisse 14

30.021 Erfahrungsaustausch zu Themen des Liquiditätsrisikomanagements 16

30.022 Erfahrungsaustausch GBS-Benchmarkdisposition 18

30.023 Operationelle Risiken: Szenarioquantifizierung für das OpRisk-Schätzverfahren und Praxisdialog (online) 20

30.040 Fachtagung EMIR – Derivate zwischen Geschäftsmodellen und Regulatorik (online) 23

30.050 NRW-Fachtagung Gesamtbanksteuerung 25

30.060 Fachtagung Erfolgsanalyse Kundengeschäft (EAK) 27

30.033 Erfahrungsaustausch zu Themen des Marktpreisrisikos 30

Gesamtbanksteuerung/Risikomanagement **32**

30.200 Kompakt-Seminar: Grundlagen der Gesamtbanksteuerung 33

30.203 Produktstrategien in Sparkassen - Implikationen für und aus der Gesamtbanksteuerung 36

30.204 Grundlagen der Banksteuerung – RTF-Konzeption (online) 38

30.214 Workshop zur Abgabe der IRRBB-Meldung zum 11.02.2025 - Regionalveranstaltung Westfalen-Lippe 40

30.231 Grundlagen der Banksteuerung - technische Grundlagen "Integrierter Datenhaushalt (IDH)" 42

30.232 Grundlagen der Banksteuerung - Analyse des variablen Geschäfts (AVG) (online) 44

30.233 Grundlagen der Banksteuerung - Analyse impliziter Optionen (AnimO) (online) 46

30.234 Grundlagen der Banksteuerung - Marktpreisrisiko (MPR) (online) 48

30.235 Grundlagen der Banksteuerung – GBS VMU: methodische und anwendungsbezogene Grundlagen normative Perspektive der RTF 50

30.236 Grundlagen der Banksteuerung - GBS-Risikotragfähigkeit - ökonomische Perspektive 53

30.237 Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - SVP-Rechner (online) 55
30.238 Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - LCR-Steuerer (online) 57
30.266 Webinar-Reihe "ESG-Risikoplan" 59
30.272 Strategische Kapitalallokation mit ic.asset-allokation - Update (online) 62
30.274 Grundlagen der Banksteuerung – fachliche Aspekte der Asset Allokation (online) 64
30.275 Grundlagen der Banksteuerung – Anwenderschulung ic.asset.allokation 67
30.276 Grundlagen der Banksteuerung – Risikoinventur inklusive Nachhaltigkeitsrisikoinventur (online) 69
30.295 Erfolgreicher Aufbau der Geschäftsfeldsteuerung in der Sparkasse 71
30.298 Ganzheitliche Kapitalanlagestrategie für Langfristinvestoren 73
30.247 Vertiefungsschulung Gesamtbanksimulation (GBS) - Bewertungsergebnis Wertpapiere, Fondsplanung und BFA-3-Simulation 75
30.248 Vertiefungsschulung Gesamtbanksimulation (GBS) - Ergebnisspaltung, virtuelle Kasse und Planung 77
30.249 Vertiefungsschulung Gesamtbanksimulation (GBS) - Kapital- und RWA-Planung 79
30.277 Grundlagen der Banksteuerung – Immobilienpreisrisiko in der ökonomischen Sicht 81
30.790 Rollout RKR 2.0 - Risikomodell zur Messung des ökonomischen Refinanzierungskostenrisikos (online) 83
Kalkulation 85
30.300 S-Datawarehouse - Grundlagen (S605) 86
30.302 S-DWH Check-up – Qualitätssicherung für Kalkulation und Steuerung 88
30.310 S-Datawarehouse - Funktionen des Änderungsdienstes für Administratoren (S606) (online) 90
30.325 Grundlagen der zahlungsstromorientierten Kalkulation (zoK 1 - Basisfunktionalitäten) 92
30.326 Zahlungsstromorientierte Kalkulation (zoK 2 - Besonderheiten und optionale Komponenten) 94
30.329 Optionskosten in der Vor- und Nachkalkulation 96
30.331 Risikoadjustierte Prämienbestimmung (RAP) in der Nachkalkulation 98
30.370 Grundlagen der Kalkulation aktiv und passiv mit MARZIPAN (S592a) 100
30.381 Tableaukonfiguration in MARZIPAN (S594) 102
30.383 Vorfälligkeitsberechnung mit MARZIPAN-KAPLAN (S593) 104
30.386 Administration von MARZIPAN (S590) 106

30.391 Neuerungen im OSPlus Release 25.0 zu Themenstellungen der Vor- und Nachkalkulation (online) 108

30.392 Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata (Teil 1) - Intensivierung und weitergehende Nutzungsmöglichkeiten (S598a) (online) 110

30.396 Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata (Teil 2) - finanzmathematische Hintergründe (S598b) (online) 112

30.399 Intensiv-Training für Einsteiger/-innen zur Vorkalkulation mit MARZIPAN 114

Reporting/Prognose/IDH 117

30.471 Management Reporting (IDH-Reporting) - Grundlagen (S695a) - (online) 118

30.472 Management Reporting (IDH-Reporting) - Aufbauveranstaltung - Erstellung von individuellen Berichten auf Basis von Standardberichtsschablonen (S695b) - (online) 120

30.473 Management Reporting (IDH-Reporting) - Expertenworkshop (S695c) - (online) 123

30.480 Umsteiger-Seminar für IDH-Anwender auf OSPlus BI (online) 125

Marktpreisrisikosteuerung 128

30.585 Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Grundlagen (online) (S671) 129

30.586 Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Handel (online) (S672) 131

30.587 Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Abwicklung (online) (S673) 133

30.592 Der Jahresabschluss mit SimCorp Dimension (S696) 135

30.591 Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Anlieferung an das Meldewesen - Aufbauseminar (S689) (online) 137

30.593 Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Transaktionsmeldewesen in SCD zu EMIR Refit (S676a) (online) 139

30.594 Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Transaktionsmeldewesen in SCD zu MiFIR Art. 26 (S676b) (online) 141

30.595 Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Transaktionsmeldewesen in SCD zu SFTR (S676c) (online) 143

41.433 Umsetzung des Investmentsteuergesetzes (InvStG) 2018 in SimCorp Dimension (SCD) 145

Zinsbuchsteuerung/GuV-Planung 147

30.601 Grundlagenschulung zur Zinsbuchsteuerung (online) 148

Liquiditätsmanagement 150

30.730 Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - Plan-Liquiditätsablaufbilanz (Plan-LAB) (online) 151

30.742 Methodische Grundlagen zum Liquiditätskostenverrechnungssystem (LVS) (online) 153
30.781 Methodische Grundlagen zum Internal Liquidity Adequacy Assessment Process (ILAAP) 155
Adressenrisikosteuerung 157
30.810 Grundlagen der Verlustschätzung unter Nutzung VDS in OSPlus 158
30.830 Grundlagen der Banksteuerung - Credit Portfolio View (CPV 5.93) (online) 160
30.860 Grundlagenschulung zum Bewertungsergebnis Kredit in GBS 162
30.861 Grundlagen zur Hard-Test-Meldung (online) 164
Steuerung operationeller Risiken 166
30.900 Grundlagen der Banksteuerung - Operationelle Risiken (OpRisk) 167

III. STAB

30 Banksteuerung

Tagungen/Praxisdialoge
Gesamtbanksteuerung/Risikomanagement
Kalkulation
Reporting/Prognose/IDH
Marktpreisrisikosteuerung
Zinsbuchsteuerung/GuV-Planung
Liquiditätsmanagement
Adressenrisikosteuerung
Steuerung operationeller Risiken

30 BANKSTEUERUNG

Tagungen/Praxisdialoge

Fachtagung Banksteuerung - Regionalveranstaltung Westfalen-Lippe

Praxisthemen im Fokus
Wir zeigen Ihnen aktuelle Handlungsfelder in der Banksteuerung auf und geben Impulse für die Umsetzung in der Sparkasse. In der Veranstaltung gibt es Neuigkeiten zu verschiedenen Themen der Banksteuerung und Antworten unter anderem auf aktuelle Fragen zu aufsichtsrechtlichen Entwicklungen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen und Führungskräfte aus den Bereichen Betriebswirtschaft und Controlling sowie Handel/Treasury

IHR NUTZEN

- Sie kennen den Sachstand zu den aktuellen Themen in der Banksteuerung und wissen, wie diese Themen in der Sparkasse umgesetzt werden können.
- Sie sind vertraut mit aktuellen aufsichtsrechtlichen Anforderungen.
- Sie profitieren vom fachlichen Austausch mit Expertinnen und Experten sowie Sparkassenkolleginnen und Sparkassenkollegen.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Mitarbeiter/-innen des SVWL, der Sparkassen-Finanzgruppe sowie externe Spezialistinnen und Spezialisten

TERMIN(E)

27.09.2027 – 28.09.2027 |
Sparkassenakademie NRW

DAUER

1,5 Tage

PREIS

675,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Die Inhalte der Fachtagung werden aktuell erarbeitet. Wir werden sie im Vorfeld des Termins mit einer separaten Akademieinfo kommunizieren.

Fachtagung Banksteuerung und Bankenaufsicht - Regionalveranstaltung Rheinland

Das wirtschaftliche und aufsichtsrechtliche Umfeld für Sparkassen ändert sich nachhaltig. In der jährlichen Fachtagung wird Fach- und Führungskräften wichtiges Wissen über aktuelle Entwicklungen in der Bankenaufsicht und der Banksteuerung vermittelt. Gleichzeitig bieten wir mit der Tagung ein Forum, um das Kompetenznetzwerk durch den Austausch mit Branchenexpertinnen und Branchenexperten sowie Kolleginnen und Kollegen zu erweitern.

ZIELGRUPPE

MaRisk-Verantwortliche der Sparkassen sowie Führungskräfte, Spezialisten/-innen und engagierte Nachwuchskräfte aus den Bereichen Gesamtbanksteuerung, Risikocontrolling, Betriebswirtschaft, interne Revision und Vorstandssekretariat

IHR NUTZEN

- Sie sind über sich abzeichnende wesentliche Veränderungen der bankaufsichtsrechtlichen Anforderungen und Trends in der Banksteuerung informiert.
- Sie wissen, welche Aktivitäten in der Sparkasse aufgrund dieser Herausforderungen angestoßen werden sollten.
- Sie profitieren vom fachlichen Austausch mit Expertinnen und Experten sowie Sparkassenkolleginnen und Sparkassenkollegen.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Mitarbeiter/-innen des RSGV, der Sparkassen-Finanzgruppe sowie externe Spezialisten

HINWEIS(E)

Wir werden die weiteren Details mit einer separaten Akademieinfo kommunizieren.

TERMIN(E)

08.09.2027 – 09.09.2027 |
Sparkassenakademie NRW

DAUER

2 Tage

PREIS

770,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Wir werden die Inhalte mit einer separaten Akademieinfo kommunizieren.

Praxisdialog Verlustdatensammlung (VDS)

Vernetzen Sie sich in unserem Praxisdialog mit anderen Sparkassen zu aktuellen Themen der Verlustdatensammlung bzw. Verlustschätzung. Profitieren Sie vom Wissenstransfer zwischen den Sparkassen und den Referierenden und vertiefen Sie Ihr Wissen zu aktuellen Themen, Herausforderungen und Fragestellungen. In der Veranstaltung werden neben Antworten auf die eingereichten Fragen auch die aktuellsten Produktpflegeergebnisse und das Release 26.1 vorgestellt.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die mit der Verlustschätzung unter Nutzung der OSPlus-Anwendung Verlustdatensammlung in der Sparkasse befasst sind, insbesondere aus den Bereichen Risikocontrolling, Kreditabwicklung und ggf. Revision (Kreditprüfer/-innen)

IHR NUTZEN

- Sie kennen die aktuellsten Produktpflegeergebnisse aus der Produktpflege 2026.
- Sie sind mit dem Release 26.1 vertraut.
- Sie profitieren vom Informationsaustausch untereinander und mit den Referierenden.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Hendrik Hütten, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
  Referent im Fachbereich Banksteuerung
- Sandro Reichwald, Sparkassen Rating und Risikosysteme GmbH
  Referent Produktbetreuung Rating
- Ludger Trenkamp, Sparkassenverband Westfalen-Lippe
  Referent für Adressenrisiko im Kompetenz-Center Banksteuerung

HINWEIS(E)

Der Fokus der Veranstaltung liegt auf dem Erfahrungsaustausch. Nutzen Sie bitte die Chance den Tag aktiv mitzugestalten, indem Sie uns vorab Ihre Fragen und gewünschten Themen einreichen. Bitte senden Sie Ihre Themenvorschläge und Fragen bis spätestens 13. Oktober 2026 an Herrn Hendrik Hütten (hendrik.huetten@rsgv.de) oder Herrn Ludger Trenkamp (l.trenkamp@svwl.eu).

TERMIN(E)

03.11.2026 | Sparkassenakademie NRW

DAUER

1 Tag
09:30 - 16:30 Uhr

PREIS

375,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Aktuellste Produktpflegeergebnisse aus der Produktpflege 2026 (Datenstichtag 31.12.2025)

Informationen zum Release 26.1 (mit Gesamteinsatz am 24.11.2026)

Erfahrungsaustausch

Beantwortung der eingereichten Praxisfragen

Praxisdialog zur Steuerung des variablen Geschäfts – Fokus: Festlegung der Mischungsverhältnisse

In diesem Praxisdialog diskutieren Sie mit Expertinnen und Experten über spezielle Fragestellungen des variablen Geschäfts. Aufgrund der Aktualität in den Sparkassen liegt der Fokus auf der Festlegung der Mischungsverhältnisse. Dabei wird insbesondere auf die strategische Bedeutung des variablen Geschäfts geblickt. In der Veranstaltung werden fachlich-methodische Informationen mit Hinweisen zur technischen Umsetzung in den Anwendungen der Finanz Informatik verknüpft.

ZIELGRUPPE

Führungskräfte und Mitarbeiter/-innen mit Praxiserfahrung aus den Bereichen Risikosteuerung und Vertriebssteuerung mit Verantwortung für die Steuerung der Passivprodukte und Festlegung der Mischungsverhältnisse

IHR NUTZEN

- Sie sind mit dem Prozess zur Ableitung der Mischungsverhältnisse für Ihre Sparkasse vertraut.
- Sie können Empfehlungen für die Steuerung des Passivgeschäftes in der Sparkassenpraxis nutzen.
- Sie erhalten Antworten auf Ihre Praxisfragen und profitieren vom gemeinsamen Austausch.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Jürgen Becker, CP Consultingpartner AG
  Experte für Risikomanagement, Aufsichtsrecht und Gesamtbanksteuerung
- Michael Biella, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
  Referent im Fachbereich Banksteuerung
- Robert Budde, Sparkassenverband Westfalen-Lippe
  Referent im Kompetenz-Center Banksteuerung

HINWEIS(E)

Bitte reichen Sie zeitnah Ihre Fragestellungen per Mail bei michael.biella@rsgv.de (RSGV-Sparkassen) oder bei r.budde@svwl.eu (SVWL-Sparkassen) ein, damit diese bei Relevanz für alle Sparkassen im Praxisdialog erörtert werden können.

Aktuelle Entwicklungen bis zum Durchführungstermin werden bei den Inhalten berücksichtigt.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

550,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Grundsätzliches Vorgehen

- Prozess zur Festlegung von Mischungsverhältnissen
- Verantwortlichkeit für die Festlegung
- Berücksichtigung der Kapitalbindung
- Produktstrategie
- Produktunterscheidung (u. a. Relevanz)
- Abbildungsmethoden (Sockel – Staffel – Stufe)
- Berücksichtigung von Profianlegern
- Sockeldisposition (Vor- und Nachteile) vs. Misch-Mischungsverhältnisse

Analyse der Kapitalbindung (caballito)

- Vergangenheits- und Zukunftsanalyse
- Methodiken zur Ermittlung Sockelvolumen
  - Finanzmarktkrise 2007 (bzw. langfristige Volumenskalierung)
  - Volumen letztmaliger Zinszahlung
  - Hybrides Modell
  - Portfoliogranularität
  - Exkurs: SR-Vorgehen gemäß Schulungsunterlage

Analyse, Ableitung und Festlegung (Zins-)MV (ZA AVG)

- Vergleich Marge – Produktzins (Historie und Planungshorizont)
- Zinselastizitäten/Zinsreagibilität
- Blick in das System (z. B. Vorschlag MV Voraussetzung: ZA mit Produktzins; segmentspezifisch, Gesamtbetrachtung)
- Gesamtwürdigung/durchschnittliche Duration

Berücksichtigung und Auswirkung in der Steuerung

- Risikomanagement (MPR, RKR, GBS VMU, BFA3, GBS ökon. RDP)
- Vertriebscontrolling/Zinsergebnisspaltung
- Periodische Ausgleichszahlungen

Aktuelle Fragestellungen und Erörterung der vorab eingereichten Fragen

Erfahrungsaustausch zu Themen des Liquiditätsrisikomanagements

Die Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement sind komplex und verändern sich fortlaufend. Mit unserem Erfahrungsaustausch bleiben Sie stets auf dem aktuellen Stand. Im Rahmen der Veranstaltung werden auftretende Probleme in der Praxis erörtert sowie Tipps und Kniffe für die Lösung aufgezeigt. Außerdem besteht die Möglichkeit, eigene Themenwünsche im Vorfeld zu adressieren. Profitieren Sie von den aufgezeigten Best-Practice-Ansätzen und vom Austausch mit anderen Nutzerinnen und Nutzern der LQR-Anwendungen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die in der Sparkasse das Themenfeld Liquiditätsrisikomanagement betreuen und für die Nutzung der LQR-Anwendungen zuständig sind

IHR NUTZEN

- Sie profitieren von Empfehlungen für den Praxiseinsatz der Anwendungen zum Liquiditätsrisikomanagement in der Sparkasse.
- Sie erhalten Antworten auf Ihre Praxisfragen und gewinnen neue Erkenntnisse durch den gemeinsamen Austausch mit Expertinnen und Experten.

VORAUSSETZUNG(EN)

Kenntnisse in der Liquiditätsrisikosteuerung sowie im Umgang mit den technischen Standardanwendungen in der Sparkassen-Finanzgruppe für diesen Bereich

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Alain Goldberg, S Rating und Risikosysteme GmbH

Johanna Hutterer, S Rating und Risikosysteme GmbH

Valentin Knoch, PPI AG

Karsten Rauch, Sparkassenverband Hessen-Thüringen

Jörg Rausmann, Sparkassenverband Westfalen-Lippe

Jürgen Robbes, Deutscher Sparkassen- und Giroverband e. V.

Melanie Schmacht, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband

Leon Unger, Deutscher Sparkassen- und Giroverband e. V.

HINWEIS(E)

Bitte unterstützen Sie uns bei der Vorbereitung des Erfahrungsaustausches und senden Ihre individuellen Fragen bzw. weitere Themenwünsche bis zum 6. November 2026 per Mail an
Frau Melanie Schmacht (melanie.schmacht@rsgv.de) bzw. an
Herrn Jörg Rausmann (j.rausmann@svwl.eu).

TERMIN(E)

02.12.2026 | Sparkassenakademie NRW

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Austausch zu folgenden LQR-Anwendungen und Themen:

- IDH-LQR-RKR 1.0 (bzw. Folgeanwendung RKR 2.0)
- IDH-SVP-Rechner
- IDH-LCR-Steuerer (inkl. LCR-Steuerer in caballito bzw. Folgeanwendung LCR-Simulation in GBS)
- IDH-Plan-LAB
- Blick auf die Ergebnisse ILAAP

Erörterung der im Vorfeld eingereichten Fragen (siehe Hinweise)

Abschlussdiskussion

Erfahrungsaustausch GBS-Benchmarkdisposition

Die benchmarkorientierte Zinsbuchsteuerung ist ein wichtiges Instrument, um das Marktpreisrisiko im Bankensektor zu managen. Der Erfahrungsaustausch GBS-Benchmarkdisposition bietet Mitarbeiterinnen und Mitarbeitern des Controllings /Risikocontrollings die Möglichkeit, sich über die Umsetzung der GBS-Benchmarkdisposition in der Banksteuerung auszutauschen und gemeinsam Best-Practice-Ansätze zu entwickeln.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen des Controllings/Risikocontrollings, die für das Marktpreisrisiko (insbesondere der Zinsbuchsteuerung) verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie vertiefen Ihre Kenntnisse in der benchmarkorientierten Zinsbuchsteuerung und profitieren vom Austausch mit anderen Sparkassen über bisherige Erfahrungen.
- Sie sind in der Lage, die GBS-Benchmarkdefinition in der Sparkassenpraxis zu nutzen.
- Sie können Ihre Fragestellungen mit Expertinnen und Experten erörtern.

VORAUSSETZUNG(EN)

Kenntnisse der benchmarkorientierten Zinsbuchsteuerung

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Helena Niewerth, RSGV
- Tim Oliver Engelke, Kreissparkasse Düsseldorf
- Carolin Schneider, SGVHT
- Heiko Paasche, Kreissparkasse Eichsfeld

HINWEIS(E)

Der Erfahrungsaustausch findet überregional in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen statt.

Ein Fragebogen zur Erfassung Ihrer bereits bestehenden Fragen wird im Vorfeld des Termins in KW 30/31 über den Teamroom Banksteuerung durch Ihren Regionalverband versandt. Bitte beachten Sie den Rücksendetermin 18.08.2025.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

4 Stunden

PREIS

190,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Kurze Einführung in die benchmarkorientierte Zinsbuchsteuerung und die Funktionalität der GBS-Benchmarkdisposition

Präsentation von Erfahrungsberichten und anschließender Austausch über die bisherigen Erfahrungen

Austausch über noch offene bzw. anstehende Fragestellungen, wie z. B. Anwendungszweck, Plausibilisierung und Steuerungsfragen

Besprechung gemeinsamer Lösungen und erfolgreicher Ansätze

Operationelle Risiken: Szenarioquantifizierung für das OpRisk-Schätzverfahren und Praxisdialog (online)

Die SR hat im Juni 2025 einen Umstiegsfahrplan zur künftigen Szenarioquantifizierung für das OpRisk-Schätzverfahren veröffentlicht. Bereits mit OSPlus Release 25.1 wird den Sparkassen dazu ein Szenariokatalog bereitgestellt. In dieser Veranstaltung wird der Umstiegsfahrplan vertiefend thematisiert. Die nächsten Schritte und der daraus resultierende Handlungsbedarf in Ihrer Sparkasse stehen dabei im Fokus. Ein Praxisdialog zur Klärung Ihrer Fragen im Themenfeld OpRisk rundet die Veranstaltung ab.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen des Controllings/Risikocontrollings und des dezentralen OpRisk-Managements (DORM), die für die Steuerung des operationellen Risikos verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie sind im Überblick über die Weiterentwicklung der SR-Methoden zum Management und Controlling operationeller Risiken und über den Handlungsbedarf in Ihrer Sparkasse informiert.
- Sie kennen Antworten auf offene Fragestellungen im Themenbereich operationelle Risiken.
- Sie profitieren vom Austausch mit anderen Sparkassen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Kenntnisse der Messung und Steuerung operationeller Risiken

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Stephan Brandes, SVN
- Karola Goeke-Ebel, RSGV
- Elena Miller, SGVHT
- Jörg Oeing, SVWL
- Markus Walter, SGVHT

HINWEIS(E)

Diese Veranstaltungen finden überregional in Zusammenarbeit mit den Sparkassenakademien Hessen-Thüringen und Niedersachsen statt.

Bitte senden Sie Ihre bestehenden Fragen im Themenfeld "Operationelle Risiken" bis zum 21. November 2025 an die OpRisk-Verantwortlichen Ihres Regionalverbandes. RSGV-Sparkassen senden ihre Fragen bitte an karola.goeke-ebel@rsgv.de und SVWL-Sparkassen bitte an j.oeing@svwl.eu.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

2 Stunden

PREIS

189,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Fachliche Grundlagen der Veranstaltung sind das im SR-Portal unter der ID 14319 veröffentlichte Dokument "Umstiegsfahrplan zur Szenarioquantifizierung" sowie das unter der ID 34998 abrufbare Dokument "Release-Info OSPlus-Release 25.1 OpRisk_V100".

Programm/Inhalt

Vorstellung des Umstiegsfahrplans zur künftigen Szenarioquantifizierung für das OpRisk-Schätzverfahren einschließlich der Darstellung des Handlungsbedarfs und der nächsten Schritte

Austausch über offene Fragestellungen im Themenfeld OpRisk

Fachtagung EMIR – Derivate zwischen Geschäftsmodellen und Regulatorik (online)

Mit der EMIR sollen systemische Risiken im europäischen Derivatemarkt eingedämmt werden. Die EMIR-Überarbeitung REFIT (EMIR 2.0) hat die Komplexität der EMIR-Meldung an die Transaktionsregister erhöht und zusätzliche Anforderungen an die Datenqualität eingeführt. Mit EMIR 3.0 müssen neue Clearingschwellen berechnet werden und die Anforderungen für clearingpflichtige Institute werden verschärft. Zugleich soll das Transaktions-Meldewesen in Zukunft deutlich vereinfacht werden.

ZIELGRUPPE

Basel-III-Verantwortliche, Risikocontroller/-innen, MaRisk-Verantwortliche und Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen (Derivate-)Handel, Geldmarktgeschäfte (z. B. Repos, Wertpapierleihe), Gesamtbanksteuerung und Auslandsgeschäft (sofern EMIR-relevante Geschäfte in der Sparkasse getätigt werden) sowie Mitarbeiter/-innen, die für die Umsetzung der Referenzzinsverordnung in der Sparkasse zuständig sind

IHR NUTZEN

- Sie kennen die zukünftigen Anforderungen aus der EMIR und die aktuellen Anforderungen der MiFID für OTC-Derivate.
- Sie sind mit den aktuellen Entwicklungen der Vertragsdokumentation von OTC-Derivaten und mit dem aktuellen Stand der BMR vertraut.
- Sie profitieren von Praxishinweisen, die Ihnen die Umsetzung in der Sparkasse erleichtern.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Patrick Arora, Deutscher Sparkassen- und Giroverband e.V. Berlin
- Dr. Patrick Büscher, Bayerische Landesbank
- Jörg Faulhaber, Deutscher Sparkassen- und Giroverband e.V. Berlin
- Olaf Pesch, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband

HINWEIS(E)

Sparkassen, die ihre EMIR-relevanten Geschäfte in Form von Botengeschäften an die DekaBank/Landesbanken weiterleiten, sind nicht die Zielgruppe dieser Fachtagung.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

425,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Tagungsleitung: Olaf Pesch, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband

10:00 - 10:10 Uhr	**Begrüßung** Olaf Pesch, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
10:10 - 11:10 Uhr	**EMIR 2.0: Erfahrungsaustausch zur EMIR-Meldung und zur Meldepflicht bei systematischen Meldefehlern | Ausblick: Zukunft des EMIR-Meldewesens** Jörg Faulhaber, Deutscher Sparkassen- und Giroverband e.V. Berlin
11:10 - 11:30 Uhr	**Kaffeepause**
11:30 - 12:30 Uhr	**EMIR 3.0: aktueller Stand zu den neuen Clearingschwellen und den Änderungen der Clearingvorschriften** Jörg Faulhaber, Deutscher Sparkassen- und Giroverband e.V. Berlin
12:30 - 13:15 Uhr	**Mittagspause**
13:15 - 14:30 Uhr	**MiFIR (Derivatebezug): aktuelle Entwicklungen – national und europäisch, insbesondere Level-II-Maßnahmen von ESMA | Auswirkungen auf (OTC-)Derivate: Meldewesen, Nachhandelstransparenz und weitere Verknüpfung mit EMIR** Patrick Arora, Deutscher Sparkassen- und Giroverband e.V. Berlin
14:30 - 14:45 Uhr	**Kaffeepause**
14:45 - 15:15 Uhr	**Vertragsdokumentation von OTC-Derivaten: neue Anhänge zum Deutschen Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV)** Dr. Patrick Büscher, Bayerische Landesbank
15:15 - 15:45 Uhr	**BMV-Review: Auswirkungen der geänderten Benchmark-Verordnung auf die Praxis** Dr. Patrick Büscher, Bayerische Landesbank
15:45 - 16:00 Uhr	**Fragen und Abschlussdiskussion**

NRW-Fachtagung Gesamtbanksteuerung

Die Fachtagung thematisiert die aktuellen aufsichtsrechtlichen Anforderungen und Trends in der Gesamtbanksteuerung. Nutzen Sie die Gelegenheit, sich mit Expertinnen und Experten über neue Entwicklungen auszutauschen. In verschiedenen Workshops erhalten Sie Einblicke, wie andere Sparkassen die aktuellen Banksteuerungsthemen erfolgreich in der Praxis umgesetzt haben. Des Weiteren bietet die Veranstaltung spannende Einblicke über den Tellerrand hinaus.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Gesamtbanksteuerung

IHR NUTZEN

- Sie sind mit aktuellen Themen der Gesamtbanksteuerung vertraut.
- Sie profitieren von Erkenntnissen, wie andere Sparkassen diese Themen effektiv in der Praxis umgesetzt haben.
- Sie nutzen die Gelegenheit zum fachlichen Austausch mit Expertinnen und Experten sowie Sparkassenkolleginnen und Sparkassenkollegen.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Die Referentinnen und Referenten teilen wir Ihnen zu einem späteren Zeitpunkt mit.

HINWEIS(E)

Die genauen Uhrzeiten teilen wir Ihnen zu einem späteren Zeitpunkt mit.

TERMIN(E)

23.02.2027 – 24.02.2027 |
Sparkassenakademie NRW

DAUER

1 Tag
2 x 0,5 Tage

PREIS

575,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Das Programm mit der Agenda veröffentlichen wir zu einem späteren Zeitpunkt.

Fachtagung Erfolgsanalyse Kundengeschäft (EAK)

Storytelling & Power-Analytics – gemeinsam in die Zukunft der EAK! Die Sparkassen in Nordrhein-Westfalen setzen – teilweise bereits seit vielen Jahren – auf die EAK. Mit dem Auswertungsjahr 2025 erfolgt der nächste Schritt - weg von den klassischen PDF-Reports und hin zu einer digitalen Auswertungsplattform. Die Fachtagung thematisiert die Inhalte der EAK, die neuen Auswertungen und das Handling der Auswertungsplattform.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen und Führungskräfte der Gesamtbank- und Vertriebssteuerung, die tiefergehende Analysen benötigen und strategische Entscheidungen mit fundierten Daten-Stories untermauern wollen

IHR NUTZEN

- Sie sind mit der neuen Auswertungsplattform für die EAK vertraut und kennen die neuen Reports.
- Sie profitieren vom Austausch mit Expertinnen und Experten über die praktische Nutzung der neuen Auswertungsplattform und der neuen Auswertungen.
- Sie können das volle Potenzial der neuen Plattform ausschöpfen, überzeugende Analysen präsentieren und die Anwendung in der Sparkassenpraxis souverän handhaben.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Mitarbeiter/-innen des SVWL, des RSGV und aus NRW-Sparkassen

HINWEIS(E)

Im Rahmen der Fachtagung werden diverse Plenumsvorträge und sechs Workshops angeboten. Sie können maximal drei Workshops auswählen. Alle angemeldeten Teilnehmer/-innen werden im Vorfeld der Tagung persönlich bezüglich ihrer Auswahl der präferierten Workshops kontaktiert.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

425,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Beginn: 9:30 Uhr
Ende: ca. 16:30 Uhr

Ab 9:00 Uhr steht für Sie ein Begrüßungskaffee bereit.

Vorträge im Plenum:

Standortbestimmung mit der EAK: Stärken erkennen, Schwächen sichtbar machen
Robert Budde, SVWL

EAK: Was ist neu, was ist anders?
Jörg Rausmann, SVWL

Die Technische Plattform: vom manuellen Prozess in automatisierte Abläufe
Alica Stuhr, PwC

Projekt Nachwuchskunden: Analyse der Zielgruppe mit der EAK als Basis für eine strategische Festlegung der Marktbearbeitung
Klaudius Komor, SVWL

Marktdaten in der EAK: Anknüpfungspunkte zur Zentralen Marktdatenbank (ZMDB)
Hendrik Stallkamp, SVWL

DSGV-Geschäftsstrategie: Einordnung der EAK in die DSGV-Geschäftsstrategie - Anknüpfungspunkte und Integration in den Gesamtzusammenhang
Dr. Fabian Wening, SVWL

Geschäftsfeldsteuerung: von normierten Kennzahlen zur hausspezifischen Umsetzung
Robert Budde, SVWL

Ausblick: Und was kommt noch?
Jörg Rausmann, SVWL

Workshops:

Workshop 1: Erste Schritte mit der EAK
Der Workshop bietet einen praxisnahen Einstieg in die EAK und zeigt anhand konkreter Erfahrungen einer Sparkasse, wie die EAK erfolgreich im Haus verankert werden kann.
Matthias Meier, Sparkasse Hilden-Ratingen-Velbert
Michael Biella, RSGV

Workshop 2: Grundlagen der EAK
Der Workshop richtet sich an Einsteiger/-innen und vermittelt die grundlegenden Methodiken und Vorgehensweisen und schafft ein verständliches Fundament für den weiteren Einsatz.
Robert Budde und Jörg Rausmann, SVWL

Workshop 3: Tiefenbohrung Privatkundengeschäft
Eine praxisnahe Analyse des Privatkundengeschäfts – produkt- und altersklassenspezifische Kennzahlen als Basis für die zukünftige Ausrichtung
Frank Hoppe und Michael Eicher, Sparkasse Münsterland Ost

Workshop 4: Rentabilität und Marktanteile
Ein praxisnaher Sparkassenbericht zeigt, wie klassische Rentabilitätskennzahlen mit neuen Kennzahlen wie Kundenreichweite und Marktanteilen verbunden werden können und den Blickwinkel deutlich erweitern.
Thomas Dinkela und Björn Theyssen, Sparkasse Westmünsterland

Workshop 5: Tiefenbohrung Firmenkundengeschäft
Ein Workshop zum Firmenkundengeschäft, der die segmentspezifischen Besonderheiten beleuchtet und konkrete Handlungsansätze für eine zielgerichtete Weiterentwicklung aufzeigt.
Alexander Böker und Beate Demmer, Sparkasse Paderborn-Detmold-Höxter

Workshop 6: Kosten und Kapazitäten
Im Workshop erläutert die Sparkasse, wie Kosten und Kapazitätsaspekte ganzheitlich integriert werden können. Dabei werden die damit verbundenen Möglichkeiten und Grenzen transparent dargestellt und Hinweise gegeben, wie diese Erkenntnisse in die Gesamtbetrachtung Ihres Geschäfts einfließen können.
Claudia Klemm und Christina Birkenhäger, Sparkasse Bielefeld

Sie können im Rahmen der Fachtagung maximal drei Workshops besuchen. Bitte beachten Sie die Details zur Auswahl der Workshops unter "Hinweise".

Erfahrungsaustausch zu Themen des Marktpreisrisikos

Die Anforderungen an das Marktpreisrisikomanagement sind komplex und verändern sich fortlaufend. Mit unserem Erfahrungsaustausch bleiben Sie stets auf dem aktuellen Stand. Im Rahmen der Veranstaltung werden auftretende Probleme in der Praxis erörtert sowie Tipps und Kniffe für die Lösung aufgezeigt. Außerdem besteht die Möglichkeit, eigene Themenwünsche im Vorfeld zu adressieren. Profitieren Sie von den aufgezeigten Best-Practice-Ansätzen und vom Austausch mit anderen Nutzerinnen und Nutzern der MPR-Anwendungen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die in der Sparkasse das Thema Marktpreisrisiko betreuen und für die Anwendungen MPR, Immobilienpreisrisiko, Zinsbuchsteuerung usw. zuständig sind.

IHR NUTZEN

- Sie sind mit MPR- bzw. anwendungsrelevanten Informationen und Neuigkeiten aus erster Hand (SR/FI) vertraut.
- Sie profitieren von Empfehlungen für den Praxiseinsatz der Anwendungen zum Marktpreisrisiko in der Sparkasse.
- Sie erhalten Antworten auf Ihre Praxisfragen und gewinnen neue Erkenntnisse durch den gemeinsamen Austausch mit Expertinnen und Experten.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Raoul Ebeling, SR
- Florian Küttler, FI
- Martin Malik, RSGV
- Dr. Florian Schackert, SR
- Carsten Thewes, SVWL

HINWEIS(E)

Bitte unterstützen Sie uns bei der Vorbereitung des Erfahrungsaustausches und senden Ihre individuellen Fragen bzw. weitere Themenwünsche bis zum 20. November 2026 per Mail an Herrn Carsten Thewes (c.thewes@svwl.eu) bzw. an Herrn Martin Malik (martin.malik@rsgv.de).

TERMIN(E)

08.12.2026 | Sparkassenakademie NRW

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Informationen und Austausch zu folgenden MPR-relevanten Themen:

- MPR – OSPlus-Release 26.1
- VKA-Parameterwechsel/Methodikanpassung
- SSR/CSRBB
- Aktuelles aus den SR-Gremien
- Erörterung der eingereichten Themen

30 BANKSTEUERUNG

Gesamtbanksteuerung /Risikomanagement

GBS-Videoaufzeichnungen

Kompakt-Seminar: Grundlagen der Gesamtbanksteuerung

Die Gesamtbanksteuerung einer Sparkasse wirkt sich auf alle Unternehmensbereiche aus. Ein grundlegendes Verständnis der Zusammenhänge in der Gesamtbanksteuerung ist auch für Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter in anderen Unternehmensbereichen wichtig, um den eigenen Aufgabenbereich im Kontext der Gesamtbankplanung und -steuerung ganzheitlich begreifen zu können. Daher bieten wir für Sie dieses Kompakt-Seminar an.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen insbesondere aus den Unternehmensbereichen Banksteuerung, Personal, Controlling, Rechnungswesen, Revision, Vorstandsstab, Marketing, Vertriebssteuerung oder aus dem Back-Office, die wichtige Zusammenhänge in der Gesamtbanksteuerung kennenlernen sollen.

IHR NUTZEN

- Sie gewinnen einen Überblick über die Steuerungssystematik einer Sparkasse auf Gesamthausebene.
- Sie wissen, wie die verschiedenen Steuerungsmöglichkeiten zusammenhängen und welche Auswirkungen sie aufeinander haben.
- Sie sind über moderne Methoden und Techniken der Vertriebsplanung und -steuerung und des Risikomanagements informiert.
- Sie können verschiedene Steuerungsansätze verstehen und bewerten.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Holger Ziehm
  Bachelor of Finance mit langjähriger Erfahrung in unterschiedlichen Bereichen der Gesamtbanksteuerung (u. a. in der Funktion Leiter Risikocontrolling) und als Referent zu verschiedenen Themen
- Michael Eickmann, Sparkasse Herford
  Bereichsdirektor Gesamtbanksteuerung, Diplom-Sparkassenbetriebswirt mit langjähriger Erfahrung im Controlling und als Referent zu verschiedenen Themen

HINWEIS(E)

Das Seminar besteht aus 2 Teilen, die individuell gebucht werden können.

TERMIN(E)

2601_Teil_2 | 02.11.2026 – 04.11.2026 | Sparkassenakademie NRW

2701_Teil_2 | 20.01.2027 – 22.01.2027 | Sparkassenakademie NRW

DAUER

5 Tage

PREIS

1.510,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

1. und 2. Tag - Holger Ziehm (Teil 1)

Grundlagen der Gesamtbanksteuerung

- Definition/Dimensionen der Gesamtbanksteuerung
- Steuerungskonzepte/Steuerungsphilosophien
- Das Gesamtbanksteuerungshaus
- Abgrenzung GuV-Steuerung versus Barwertsteuerung
- Strategie, Planung und MaRisk
- "Gesamthaussteuerung"

Vertriebssteuerung

- Aktivitätensteuerung
- Kredite-/Einlagen-/Geldanlagen-/Verbundgeschäft
- Ertragsorientierung im Vertrieb
- Was sind die richtigen Zielgrößen, Messverfahren und Steuerungsgrößen?
- Potenzialorientierte Planung/Steuerung
- Wertschöpfungskette im Vertrieb
- Operative Steuerung
- Produkt- und Konditionensteuerung
- Kundenkalkulation
- Adressrisiko in der Vertriebssteuerung
- ProfitCenterrechnung
- Vertriebsplanung/Vertriebsstrategie/potenzialorientierte Planung
- "Vertriebscockpit" - Vertriebsberichte

3. bis 5. Tag - Michael Eickmann (Teil 2)

Risikosteuerung

- Grundlagen der Risikosteuerung aus aufsichtlicher und ökonomischer Sicht
- RTF-Ermittlung nach dem aufsichtlichen Leitfaden
- Ökonomische und normative Risikotragfähigkeit
- Praktische Umsetzung in der S-Finanzgruppe
- Bestimmung der wesentlichen Risiken
- Statistische und methodische Grundlagen der Risikoermittlung
- Szenariotechnik
- IDH als Single Point of Truth
- Datenqualitätsmanagement als Voraussetzung valider Ermittlungen
- Wesentliche Komponenten der neuen Banksteuerung:
  - Marktpreisrisiko – MPR
  - Adressrisiko – ADR (und CPV)
  - Liquiditätsrisiko – LQR
  - Gesamtbanksimulation – GBS
- Operationelles Risiko

Unternehmenssteuerung – hier läuft alles zusammen

- Geschäftsfeldrechnung
- Benchmarking und Kennzahlensteuerung
- Strategische Ausrichtung
- Von der Risiko- zur Ertragssicht: Wir kennen das Risiko, aber welches sollen wir eingehen?

Produktstrategien in Sparkassen - Implikationen für und aus der Gesamtbanksteuerung

Die Produktgestaltung der Sparkasse, die damit einhergehende Kalkulation und deren Wirkung in der Gesamtbank stehen im Fokus dieser Veranstaltung. Profitieren Sie von Erkenntnissen aus Praxisbeispielen für die Kalkulation und zur konsistenten Produktgestaltung.

ZIELGRUPPE

Leiter/-innen des Bereichs Gesamtbanksteuerung

IHR NUTZEN

- Sie sind mit der Strategie einer konsequenten Ausrichtung des Produktkataloges der Sparkasse an den Kundenbedürfnissen und -wünschen vertraut.
- Sie kennen Praxisbeispiele für die Kalkulation und konsistente Produktgestaltung mit einer möglichst schlanken Angebotspalette.
- Sie können die Risiken der Produktpalette auf die Ziele der Gesamtbank einschätzen und sind mit Maßnahmen zur Reduktion dieser Risiken vertraut.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Dr. Andreas Beck, ICnova AG

Robert Budde, Sparkassenverband Westfalen-Lippe

Michael Biella, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag
09:30 - 16:30 Uhr

PREIS

450,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Vorbemerkungen

- Produktstrategie im neuen Zinsumfeld
- "Neue" Wechselwirkungen zur ökonomischen Risikotragfähigkeit und zum BFA3

Überblick Produktstrategie und zentrale Fragestellungen

- Zielsetzung
- Kundenbedürfnisse und Vertriebsstrategie
- Verzahnung Geschäfts- und Risikostrategie
- Produktspezifische Risiken
- Produktkalkulation
- Deckungsbeitragsrechnung

Produktkalkulation

- Bewertungskurven – was ist die richtige Zinskurve?
- Absicherung von Zins-, Options- und sonstigen Risiken
- Liquiditätskosten und Liquiditätsnutzen
- Margen und (Netto-)Margenbarwert Festzinsgeschäft
- Bewertungszins Variables Geschäft
- Deckungsbeitragsrechnung und Preisuntergrenze

Produktdesign und -angebot

- Kundenbedürfnisorientierte Produktgestaltung – welche Produkte für welchen Zweck?
- Aktiv-Produkte – speziell auch langlaufende Darlehen
- Passiv-Produkte
- Provisionsgeschäft
- Make or Buy – Investitionskostenrechnung als Ausgangsbasis zur Entscheidungsfindung
- Plattformgeschäft – Nutzen und Fallstricke
- Konsistente Konditionen- und Leistungsgestaltung
- Trennscharfe Produkte – Vermeidung von Selbstkannibalisierung
- Anreize zur bedarfsgerechten Selbstselektion
- Umgang mit Sonderkonditionen
- Umgang mit Volumenklassen
- Spezielle Behandlung einzelner Kundensegmente (z. B. Firmenkunden/Privatkunden)
- Umgang mit Volumensumschichtungen
- Praxisbeispiele

Grundlagen der Banksteuerung – RTF-Konzeption (online)

Ein Überblick der aufsichtlichen Anforderungen zur RTF-Konzeption sowie die Grundzüge der Umsetzung der Anforderungen in der S-Finanzgruppe stehen im Fokus dieses Grundlagenseminars. Es ist insbesondere für neue Mitarbeiter/-innen im Bereich der Risikotragfähigkeit und Stresstests konzipiert.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen im Bereich der Risikotragfähigkeit und Stresstests und Mitarbeiter/-innen, die ihr methodisches Grundlagenwissen im Themenkomplex der RTF-Konzeption inkl. Stresstest auffrischen möchten

IHR NUTZEN

- Sie sind überblicksartig mit methodischem Wissen zu den aufsichtlichen Anforderungen an die RTF-Konzeption vertraut.
- Sie kennen die entsprechende Umsetzung in der Sparkassen-Finanzgruppe.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Viktoria Franke, Abteilung Steuerung und Reporting, SGVHT

HINWEIS(E)

Das Seminar ist keine technische Schulung der Anwendungen.

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten. Ausführliche Informationen (z. B. Termin/e und Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen über folgenden Link: Buchungsportal Hessen-Thüringen

Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

Hinweis zur Abgrenzung dieser Veranstaltung zum Kompakt-Seminar "Grundlagen der Gesamtbanksteuerung" (Angebotsnummer 30.200): Dieses Seminar geht inhaltlich /fachlich in Bezug auf die RTF über das Kompakt-Seminar hinaus.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

2 Tage

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Aufsichtliche Anforderungen zur RTF-Konzeption inkl. Stresstests (ökonomisch und normativ)

Grundzüge der Umsetzung der Anforderungen in der S-Finanzgruppe

Umsetzung der ökonomischen Perspektive

- Struktur der Risikoarten und -kategorien
- Ökonomisches Risikodeckungspotential
- Grundzüge der ökonomischen Risikoquantifizierung

Stresstestprogramm in der S-Finanzgruppe

- Stresstest in der ökonomischen Perspektive
- Adverse Szenarien in der normativen Perspektive

Risiken aus Verbundbeteiligungen

Angemessenheit der Methoden und Verfahren

Workshop zur Abgabe der IRRBB-Meldung zum 11.02.2025 - Regionalveranstaltung Westfalen-Lippe

Mit Blick auf den IRRBB-Meldestichtag 31.12.2024 und die Abgabefrist bis zum 11.02.2025 bieten wir diesen zweiteiligen Online-Workshop an. Er richtet sich an Institute, die nach der ersten IRRBB-Meldung mit Abgabe am 11.11.2024 mehr Sicherheit und eine erhöhte Routine bei der Abgabe der Meldung sowie der Interpretation der Warnings/RfI (Request for Information) im Rahmen der PRISMA-Rückmeldung nach IRRBB-Meldeabgabe sicherstellen möchten.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen mit Zuständigkeit für die IRRBB-Meldung und für die Themenbereiche MPR, GBS, AnimO sowie BAIS

IHR NUTZEN

- Sie erhalten detaillierte Einblicke in die neuesten Entwicklungen und Empfehlungen im Bereich der IRRBB-Meldung.
- Sie können die IRRBB-Meldung zum 11.02.2025 routiniert vollziehen.
- Sie klären Ihre Praxisfragen mit Expertinnen und Experten.

VORAUSSETZUNG(EN)

Fortgeschrittene Kenntnisse in den beteiligten Verfahren (AnimO, GBS, MPR und BAIS)

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Mitarbeiter/-innen der PPI AG

HINWEIS(E)

Der Teilnehmerkreis im Modul 1 ist auf maximal 20 Sparkassen begrenzt; im Modul 2 können maximal 10 Sparkassen je Termin teilnehmen. Die Anzahl an Mitarbeiter/-innen je Sparkasse ist nicht begrenzt.

TERMIN(E)

Modul 1: 06.01.2025 von 13:00 - 17:00 Uhr

Modul 2: 06.02.2025 von 09:00 - 13:00 Uhr oder alternativ 07.02.2025 von 09:00 - 13:00 Uhr

DAUER

1 Tag
4 Stunden je Modul

PREIS

347,50 € je Modul

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Modul 1 (Dauer: 4 Stunden)
IRRBB - Aktuelles und Vorstellung Plausibilisierungsvorgehen

- Darstellung des Plausibilisierungsvorgehens, für welches Sie verschiedene Excel-Tools und Beschreibungen erhalten.
- Termin: 06.01.2025 von 13:00 - 17:00 Uhr

Modul 2 (Dauer: 4 Stunden)
IRRBB - Aktuelles und Q&A

- Im Rahmen einer auf maximal 10 Sparkassen limitierten Q&A-Session vier Wochen nach Modul 1 erhalten Sie die Gelegenheit, Ihre Fragen zur Meldung allgemein sowie zum Plausibilisierungsvorgehen aus der vorherigen Veranstaltung gezielt einzubringen. Für das Modul 2 stehen zwei Auswahltermine zur Verfügung.
- Termine: 06.02.2025 von 09:00 - 13:00 Uhr oder alternativ 07.02.2025 von 09:00 - 13:00 Uhr
- Voraussetzung ist die Teilnahme am Modul 1

Grundlagen der Banksteuerung - technische Grundlagen "Integrierter Datenhaushalt (IDH)"

Diese technische IDH-Grundlagenschulung vermittelt praxisnahes Wissen zu den zentralen Funktionen und Hintergründen des IDH in der Banksteuerung. Sie bietet insbesondere neuen Mitarbeiterinnen und Mitarbeitern im Risikocontrolling und in der Banksteuerung die Möglichkeit, alle notwendigen technischen Grundlagen zu erlernen, um sicher und effizient mit den IDH-Anwendungen arbeiten zu können.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die technischen Zusammenhänge im IDH.
- Sie sind in der Lage, im IDH-Reporting Bestandsabgleiche und Analysen durchzuführen.
- Sie können zentrale Korrekturen im IDH über IKD vornehmen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Betriebswirtschaftliche Grundkenntnisse

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Florian Ihde, PPI AG
- Jonas Schuchmann, PPI AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten. Ihre Anmeldungen erfolgen über die Sparkassenakademie Nordrhein-Westfalen.

TERMIN(E)

10.11.2026 | virtueller Seminarraum

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Ziele und Grundgedanke des IDH

Überblick über die IDH-Systemlandschaft sowie deren Vorsysteme und Datenflüsse

Analysemöglichkeiten im IDH-Reporting

Vollständigkeitsprüfungen und Bestandsabgleiche im IDH-Reporting

Zentrale Korrekturmöglichkeiten und Datenpflege in IKD

Grundlagen der Banksteuerung - Analyse des variablen Geschäfts (AVG) (online)

In dieser Veranstaltung werden die fachlich-methodischen Grundlagen der Abbildung des variablen Geschäfts in der modernen Banksteuerung der Sparkassen vermittelt und wesentliche Praxisfragen erörtert. Darüber hinaus erhalten Sie einen Überblick zur Funktionsweise und zu den Analysemöglichkeiten der Anwendung IDH-AVG.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung (insbesondere für die Anwendung AVG) ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen im Überblick die fachlich-methodischen Hintergründe zur Kalkulation und Disposition des variablen Geschäfts.
- Sie sind mit der Funktionsweise und den Analysemöglichkeiten sowie Grenzen von AVG vertraut.

VORAUSSETZUNG(EN)

Betriebswirtschaftliche Grundkenntnisse

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Christoph Bleses, PPI AG
- David Mulaj, PPI AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten. Ihre Anmeldungen erfolgen über die Sparkassenakademie Nordrhein-Westfalen.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Vorbemerkung und Abgrenzungen

Fachlich-methodische Grundlagen des variablen Geschäfts

- Methode der gleitenden Durchschnitte
- Vergangenheitsanalyse
- Zukunftsanalyse
- Praxisfragen
- Abhängigkeiten zur Disposition

Vorstellung IDH-AVG

- Einordnung und Abhängigkeiten
- Parametrisierung
- Analysefunktionen
- Schnittstellen

Abschlussdiskussion

Grundlagen der Banksteuerung - Analyse impliziter Optionen (AnimO) (online)

In dieser Veranstaltung erfolgt eine Einführung in die Grundlagen der impliziten Optionen und den Methodenmehrwertdienst AnimO. Zudem werden fachliche Hintergrundinformationen zur Regressionsanalyse vermittelt sowie kurze Exkurse zu angrenzenden Systemen behandelt. Des Weiteren werden umfassende Informationen zur institutsindividuellen Validierung der Parameter vermittelt.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling bzw. in der Banksteuerung ausgebildet werden und für eine Tätigkeit in diesem Thema vorgesehen sind sowie Führungskräfte, die Grundlagen zu diesem Thema erwerben/auffrischen möchten

IHR NUTZEN

- Sie sind mit den Grundlagen der impliziten Optionen und mit dem Methodenmehrwertdienst AnimO vertraut.
- Sie sind über die regelmäßigen Tätigkeiten (insbesondere der jährlichen Validierung der Parameter) informiert.
- Sie kennen die Auswirkungen auf angrenzende Systeme der neuen Banksteuerung.

IHR REFERENT

- Horst Burger, Sparkasse LeerWittmund
- René Schlüsselburg, Sparkassenverband Niedersachsen

HINWEIS(E)

Diese Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Niedersachsen, der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten. Sie wird von der Sparkassenakademie Niedersachsen durchgeführt.

Anmeldungen für diese Veranstaltung nehmen Sie bitte direkt über die Sparkassenakademie Niedersachsen vor. Ausführliche Informationen (z. B. Termin/e und Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen über folgenden Link: Buchungsportal Sparkassenakademie Niedersachsen

Ihre Ansprechpartnerin bei der Sparkassenakademie Niedersachsen ist Frau Petra Kauke, Mail: petra.kauke@svn.de

Reichen Sie Ihre Fragen bitte bis drei Wochen vor dem Durchführungstermin per E-Mail an rene.schluesselburg@svn.de ein.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einführung in fachliche und technische Grundlagen zum Thema der impliziten Optionen

Zusammenfassung der wichtigsten zentralen Dokumente

Hinweise zur Analyse der impliziten Optionen mit der Anwendung AnimO

Fachliche Interpretation von Regressionsergebnissen aus den AnimO-Regressionsanalysen sowie der Poolparameter der SR

Umfassende Informationen zu den regelmäßigen Tätigkeiten, insbesondere der jährlichen Validierung der Parameter

Auswirkung auf angrenzende Systeme der neuen Banksteuerung

Auswirkungen auf die Nachkalkulation (zok)

Besprechung von vorab eingereichten Fragen der Teilnehmer/-innen

Grundlagen der Banksteuerung - Marktpreisrisiko (MPR) (online)

In dieser Veranstaltung erhalten Sie detaillierte Einblicke in den aktuellen fachlichen und technischen Umsetzungsstand zum Thema Marktpreisrisiko. Betrachtet werden die aufsichtsrechtlichen und fachlichen Inhalte zur Methodik und Parametrisierung sowie die Anwendung in der Banksteuerung. Es erfolgt eine praxisnahe Vermittlung von MPR unter Berücksichtigung des Zusammenwirkens mit dem IDH.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung (insbesondere für die Anwendung MPR) ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die aufsichtsrechtlichen und fachlichen Grundladen und Hintergründe der Methodik und Parametrisierung von MPR (Barwertkonzept, Risikofaktoren, Risikomodelle).
- Sie sind in der Lage, die Anwendung MPR in der Sparkassenpraxis zu bedienen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Betriebswirtschaftliche und mathematische Grundkenntnisse

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Martin Malik, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
- Carolin Schneider, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen
- David Mulaj, PPI AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten. Die Anmeldungen erfolgen über die Sparkassenakademie Nordrhein-Westfalen.

Die Themen AVG, AnimO und Immobilienpreisrisiken sind keine Bestandteile dieser Schulung.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

2 Tage

PREIS

750,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einordung der Thematik in die Gesamtbanksteuerung und SFG-Steuerungssysteme

Marktpreisrisiko

- Definition
- Aufsichtsrechtliche Anforderungen
- Varianz-Kovarianz-Ansatz (VKA)
  - Risikofaktoren
  - VKA
    - Barwert
    - Delta-Normal vs. Delta-Gamma-CF
    - Riskiokennzahlen
- Szenarioanalyse (Stresstests, IRRBB)
- Historische Simulation

MPR-Anwenderschulung

- Konfiguration, Marktdaten, Parameter, Simulation, Plausibilisierung, Szenarien, IDH
  - Voreinstellungen (Portfoliokonfiguration, Portfoliohierarchie, Risikofaktorsets usw.)
  - Varianz-Kovarianz-Rechnung
  - Szenariorechnung
  - Historische Simulation
  - Cashflow- und Sensitivitätenauswertung
  - IRRBB-Verarbeitung

Abschlussdiskussion

Grundlagen der Banksteuerung – GBS VMU: methodische und anwendungsbezogene Grundlagen normative Perspektive der RTF

In dieser Veranstaltung erhalten Sie detaillierte Einblicke in den aktuellen fachlichen und technischen Umsetzungsstand in der Gesamtbanksimulation normativ. Dabei stehen die methodischen und anwendungsbezogenen Grundlagen GBS VMU normative Perspektive (Bilanz- und GuV-Planung sowie "Standardisierte Hochrechnung") im Fokus. Im praktischen Teil zu den anwendungsbezogenen Grundlagen werden Sie in der Anwendung GBS ein Teilszenario Planung sowie ein Gesamtszenario anlegen.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen, die zukünftig in GBS VMU die Szenariorechnung (u. a. SHR, Mittelfristplanung, periodische Szenariorechnung – Bilanz und GuV) betreuen werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen und technischen Hintergründe der Gesamtbanksimulation.
- Sie sind in der Lage, die GBS (normativ) eigenständig zu konfigurieren und die daraus resultierenden Ergebnisse zu plausibilisieren.
- Sie können in der Sparkassenpraxis sicher und effizient mit der GBS arbeiten.

VORAUSSETZUNG(EN)

Im Rahmen des Seminars wird im Echtsystem GBS VMU der Sparkasse gearbeitet. Hierzu ist es zwingend erforderlich, dass Sie eine der beiden folgenden Voraussetzungen für die Teilnahme erfüllen können:

Variante 1:
Sie bringen einen SEVA-Token mit der Berechtigung TSR der Sparkasse inkl. der Zugangskennungen mit. Außerdem müssen Sie Ihren Benutzernamen und das Passwort kennen. Andere Anmeldeverfahren (wie z. B. Single Sign On, Chipkarte oder Fingerabdruck) müssen für die Dauer der Schulung umgestellt werden.

Variante 2:
Sie bringen ein Endgerät (Arbeitslaptop) Ihrer Sparkasse mit Zugang zum Echtsystem (SEVA-Token) mit und nutzen diesen im Seminar.

Da für einen Zugriff auf das Echtsystem mittels SEVA entsprechende Anweisungen gelten, stimmen Sie bitte die Organisation und Bereitstellung der Token mit Ihrer IT-Orga ab und beachten bitte die Hinweise der Finanz Informatik.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Sabine Kosteletzky, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen
- David Mulaj, PPI AG

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

4 Tage

PREIS

1.500,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Nordkooperation in Zusammenarbeit mit der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten.

Ein weiterer (inhaltlich identischer) Termin dieser Veranstaltung wird vom 20.04. - 23.04.2026 (09:30 – 16:30 Uhr) in Erfurt angeboten. Anmeldungen für diesen Termin nehmen Sie bitte direkt über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen vor. Zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen gelangen Sie über folgenden Link: Buchungsportal Hessen-Thüringen

Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

Programm/Inhalt

Methodische Grundlagen GBS VMU normative Perspektive

- Grundlagen der Szenariorechnung – Bilanz und GuV
- Standardisierte Hochrechnung (SHR)
- GBS VMU
  - Grundeinstellungen GBS VMU
  - Datenvorverarbeitung (DVV)
  - Teilszenario Planung
  - Gesamtszenario
  - Bilanz und GuV

Anwendungsbezogene Grundlagen in GBS VMU normative Perspektive

- Grundeinstellungen GBS VMU
- Datenvorverarbeitung (DVV)
- Anlage eines Teilszenarios Planung
- Erstellen eines Gesamtszenarios
- Bilanz und GuV
- Mustervorgehen/Prozessablauf am Beispiel der SHR

Im Teil anwendungsbezogene Grundlagen werden die Teilnehmer/-innen in der Anwendung GBS ein Teilszenario Planung sowie ein Gesamtszenario anlegen.

Grundlagen der Banksteuerung - GBS-Risikotragfähigkeit - ökonomische Perspektive

In dieser Veranstaltung erhalten Sie detaillierte Einblicke in das fachliche und technische Vorgehen der ökonomischen Perspektive der Risikotragfähigkeit in GBS. Betrachtet werden fachliche Grundlagen der ökonomischen Risikotragfähigkeit und das Zusammenwirken mit den Fragestellungen normative Risikotragfähigkeit, Risikoinventur und Stresstests. Es erfolgt eine praxisnahe Vermittlung der GBS (ökonomische Perspektive) unter Berücksichtigung des Zusammenwirkens mit dem IDH.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung (insbesondere für die Anwendung GBS - ökonomische Perspektive) ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen Grundlagen und Hintergründe der ökonomischen Risikotragfähigkeit.
- Sie sind mit grundlegenden Aspekten der Anwendung in der Praxis vertraut.
- Sie sind in der Lage, das Softwaremodul GBS (ökonomische Perspektive) in der Sparkassenpraxis zu bedienen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Betriebswirtschaftliche Grundkenntnisse

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- David Mulaj, PPI AG
- Dr. Michael Lesko, PPI AG
- Jan Oraca, PPI AG

HINWEIS(E)

Diese Veranstaltung bieten wir in Zusammenarbeit mit der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie an. Ihre Anmeldungen erfolgen über die Sparkassenakademie NRW. Bitte melden Sie alle Ihre Teilnehmer/-innen individuell im Akademieportal an (kein Paketpreis).

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einordnung der Fragestellung in die Gesamtbanksteuerung und SFG-Steuerungssysteme

Ökonomische Perspektive der Risikotragfähigkeit

- Ökonomisches Risikodeckungspotenzial
  - Zentrale Positionen des Risikodeckungspotenzials
  - Praxisbeispiel und Herausforderungen
- Ökonomisches Risiko
  - Additive Risikobetrachtung
  - Diversifizierte Risikobetrachtung und Ergebniszerlegung
  - Praxisbeispiel und Herausforderungen

GBS (ökonomische Perspektive): Anwenderschulung

- Konfiguration, Einstellungen, IDH, Plausibilisierung
- Praxisbeispiel

Abschlussdiskussion

Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - SVP-Rechner (online)

In dieser Veranstaltung erhalten Sie detaillierte Einblicke in den fachlichen und technischen Umsetzungsstand zum Thema SVP-Rechner. Betrachtet werden die fachlichen Inhalte zur Methodik und Parametrisierung sowie die Umsetzung der regulatorischen Anforderungen in der Anwendung. Es erfolgt eine praxisnahe Vermittlung des Moduls SVP-Rechner und eine Einordnung in die Banksteuerungsarchitektur des IDH.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung (insbesondere für die Anwendung SVP-Rechner) ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen Grundlagen und Hintergründe der Methodik und Parametrisierung des LQR-Moduls SVP-Rechner.
- Sie sind in der Lage, die Anwendung in der Sparkassenpraxis zu bedienen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Betriebswirtschaftliche Grundkenntnisse

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Jörg Rausmann, Sparkassenverband Westfalen-Lippe
- Karsten Rauch, Sparkassenverband Hessen-Thüringen
- Valentin Knoch, PPI AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten.

Ein weiterer (inhaltlich identischer) Termin dieser Veranstaltung wird am 10.11.2026 (09: 30 - 13:00 Uhr) über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten. Anmeldungen für diesen Termin sind über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen vorzunehmen.

Zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen gelangen Sie über folgenden Link: **Buchungsportal Sparkassenakademie Hessen-Thüringen**

Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

3,5 Stunden

PREIS

295,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einordnung von LQR in die Anwendungslandschaft des IDH im Rahmen der Gesamtbanksteuerung

SVP-Rechner: das Modell und der Praxiseinsatz

- Fachliche Grundlagen
- Methodik und Parametrisierung
- Anwenderschulung
- Plausibilisierung der Ergebnisse

Abschlussdiskussion

Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - LCR-Steuerer (online)

In dieser Veranstaltung erhalten Sie detaillierte Einblicke in den fachlichen und technischen Umsetzungsstand zum Thema LCR-Steuerer. Betrachtet werden die fachlichen Grundlagen zur Methodik und Parametrisierung sowie die Umsetzung der regulatorischen Anforderungen in der Anwendung. Es erfolgt eine praxisnahe Vermittlung des Moduls LCR-Steuerer und eine Einordnung in die Banksteuerungsarchitektur des IDH.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung (insbesondere für die Anwendung LCR-Steuerer) ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen Grundlagen und Hintergründe der Methodik und Parametrisierung des LQR-Moduls LCR-Steuerer.
- Sie sind in der Lage, die Anwendung in der Sparkassenpraxis zu bedienen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Betriebswirtschaftliche Grundkenntnisse

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Valentin Knoch, PPI AG
- Melanie Schmacht, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
- Markus Weck, Sparkassenverband Niedersachsen

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung mit der Sparkassenakademie Niedersachsen, der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten.

Ein weiterer (inhaltlich identischer) Termin dieser Veranstaltung wird am 08.09.2026 (09: 30 - 13:00 Uhr) über die Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten. Anmeldungen für diesen Termin sind über die Sparkassenakademie Niedersachsen vorzunehmen.

Zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen gelangen Sie über folgenden Link: Buchungsportal Sparkassenakademie Niedersachsen

Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Niedersachsen ist Frau Petra Kauke, Mail: petra.kauke@svn.de.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

3,5 Stunden

PREIS

295,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einordnung von LQR in die Anwendungslandschaft des IDH im Rahmen der Gesamtbanksteuerung

LCR-Steuerer: das Modell und der Praxiseinsatz

- Fachliche Grundlagen
- Methodik und Parametrisierung
- Anwenderschulung
- Plausibilisierung der Ergebnisse

Abschlussdiskussion

Webinar-Reihe "ESG-Risikoplan"

Die EBA-Leitlinien zum Management von ESG-Risiken, die CRD VI, das BRUBEG /KWG und die am 30. Juni 2026 veröffentlichte 9. MaRisk-Novelle verlangen von Sparkassen, ESG-Risiken weiterhin systematisch in das Risikomanagement zu integrieren. Die Erstellung eines ESG-Risikoplans ist eine der zentralen neuen Anforderungen. Der DSGV hat mit dem Muster-ESG-Risikoplan eine Vorlage bereitgestellt, um diese Anforderung zu erfüllen. Diesen Plan muss jedoch jedes Institut individualisieren und auf seine eigenen Gegebenheiten anpassen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Risikomanagement, Strategie sowie zentrales Nachhaltigkeitsmanagement. Das Angebot richtet sich insbesondere an die Fachebene und Expertinnen/Experten aus Risikocontrolling, Kreditorganisation, Marktfolge Kredit, Firmenkunden sowie Nachhaltigkeits- und Strategiebereichen.

Für Mitglieder des Vorstandes ist in Kürze ein zielgruppenspezifisches Angebot buchbar.

IHR NUTZEN

- Sie können die aktuellen aufsichtlichen Anforderungen an den ESG-Risikoplan praxisnah einordnen.
- Sie sind mit praktischen Umsetzungshinweisen zum Umgang mit NGFS-Szenarien vor dem Hintergrund der Resilienzanalyse vertraut.
- Sie kennen konkrete Ansatzpunkte zur Umsetzung der ESG-Anforderungen und können den ESG-Risikoplan Ihres Hauses Schritt für Schritt individualisieren und fertigstellen.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Mitarbeiter/-innen der S-Servicepartner Deutschland GmbH

HINWEIS(E)

Im Kontext der Bankenregulierung und des Risikomanagements bezeichnen SNCI und ONLI zwei unterschiedliche Klassifizierungen von Banken. Der Unterschied liegt in der Komplexität des Instituts und dem Zeitplan, ab wann die jeweiligen Vorschriften und Berichtsformate angewendet werden müssen. Die Einstufung als SNCI- oder als ONLI-Sparkasse resultiert aus Vorgaben der Bankenaufsicht.

SNCI: Small and Non-Complex Institution (kleine und nicht-komplexe Institute)
ONLI: Other Non-Large Institution (sonstige Institute, die keine großen Institute sind)

Terminübersicht:

	Modul 1	Modul 2	Modul 3
Serie 1	28.09.2026	09.10.2026	30.10.2026
Serie 2	13.10.2026	05.11.2026	10.11.2026
Erfahrungsaustausch (modulbezogen)	04.12.2026	10.12.2026	16.12.2026

TERMIN(E)

30.10.2026 | virtueller Seminarraum
09:00 – 13:00 Uhr

05.11.2026 | virtueller Seminarraum
09:00 – 13:00 Uhr

10.11.2026 | virtueller Seminarraum
09:00 – 13:00 Uhr

04.12.2026 | virtueller Seminarraum
09:00 – 13:00 Uhr

10.12.2026 | virtueller Seminarraum
09:00 – 13:00 Uhr

16.12.2026 | virtueller Seminarraum
09:00 – 13:00 Uhr

DAUER

24 Stunden

PREIS

Preis für die Module 1 bis 3: 299,00 EUR je Modul und Preis je Erfahrungsaustausch: 249,00 EUR

Sie können zwischen Serie 1 und Serie 2 wählen. ONLI-Sparkassen wird empfohlen, nach Möglichkeit die Serie 1 zu buchen, da die Webinartermine früher beginnen. SNCI-Sparkassen können die Serien 1 oder 2 buchen.

Die Module 1 bis 3 sind einzeln buchbar. Bei Terminverhinderung kann auf die andere Serie ausgewichen werden. Zu jedem Modul findet ein eigenständiger Erfahrungsaustausch statt (gemeinsamer Termin für die Serien 1 und 2).

Bei voller Nutzung des Angebotes sind drei Modultermine und drei Erfahrungsaustauschtermine je Mitarbeiter/-in zu buchen. Bitte melden Sie jede/n teilnehmende/n Mitarbeiter/-in einzeln an. Es können unterschiedliche Personen auf die Termine gebucht werden.

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Modul 1: Aufsichtliche Anforderungen und ESG-Risikoplan

- Überblick über aktuelle regulatorische Entwicklungen
- Erweiterte Anforderungen an Strategie und Strategieprozess
- Fokus ESG-Risikoplan: Struktur, Inhalte und Best-Practice-Ansätze
- Geschäftsumfeldanalyse und Resilienzanalyse als Teil der Risikobetrachtung

Modul 2: Szenarien und Resilienzanalyse

- Einführung in die NGFS-Szenarien
- Fokus auf die Resilienzanalyse
- Einordnung qualitativer und quantitativer Ansätze
- Ableitung praktischer Umsetzungsschritte

Modul 3: Strategie, KRIs, Maßnahmen und Governance

- Einbindung von ESG-Risiken in Strategie und Risikostrategie
- Ableitung geeigneter KRIs
- Entwicklung von Maßnahmen und Zielgrößen
- Governance, Zuständigkeiten und Dokumentation
- Integration in Regelprozesse, Reporting und Überwachung (u. a. in schriftlich fixierte Ordnung und "Internes Kontrollsystem")

Individuell für jedes Modul wird ein Erfahrungsaustausch mit themenspezifischer Erörterung von Best-Practice-Ansätzen und Hinweisen zur Praxisumsetzung angeboten.

Strategische Kapitalallokation mit ic.asset-allokation - Update (online)

Die Software ic.asset-allokation unterstützt als betriebswirtschaftliches Planungsinstrument die ganzheitliche Vermögensanlage der Sparkasse und die quantitative Fundierung der Geschäfts- und Risikostrategie. Die Anwendung steht seit diesem Jahr allen Sparkassen kostenfrei zur Verfügung und ist Nachfolger des Produktes S-KARISMA. In diesem Webinar werden insbesondere die Unterschiede zwischen S-KARISMA und ic.asset-allokation thematisiert.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen im Controlling und Treasury, die bereits mit der Software „ic.asset-allokation“ bzw. mit der Vorgängerversion „S-KARISMA“ arbeiten. Neue Mitarbeiter/-innen profitieren vom Webinar, da ein Überblick über die Leistungsfähigkeit der Software „ic.asset-allokation“ gegeben wird.

IHR NUTZEN

- Sie kennen im Überblick die Software ic.asset-allokation und die wesentlichen Neuerungen anhand einer Beispielsparkasse.
- Sie sind mit den Unterschieden im Handling zwischen ic.asset-allokation und S-KARISMA vertraut.

IHR REFERENT

Martin Hesl, ICnova AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Nord-Kooperation in Zusammenarbeit mit der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

2,5 Stunden

PREIS

195,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Parameterpflege

- Renditen, Risikokennzahlen, Korrelationen
- LCR-Parameter
- RWA-Parameter

Marktdaten

- Pflege Marktdaten
- Zeitreihenanalyse

Geschäftsdaten

- Vermögensbilanz
- Bilanz- und Planungsdaten

Analysen

- Risikoübersicht
- Optimierungsergebnisse
  - LCR-Ergebnisse
  - RWA-Restriktionen im Kunden- und Eigengeschäft
  - Detailanalyse Zinsrisiko
- Strategische Planung

Grundlagen der Banksteuerung – fachliche Aspekte der Asset Allokation (online)

Im Eigenanlagenmanagement umfasst die Asset Allokation die gezielte und strategische Verteilung von Eigen- und Anlagevermögen auf verschiedene Anlageklassen. Ziel ist es, das Ertrags-Risiko-Verhältnis zu optimieren. Diese Methodik ist ein zentraler Bestandteil der Risikostrategie und gewährleistet eine MaRisk-konforme Steuerung der Risikotragfähigkeit. In dieser Veranstaltung steht die Verzahnung der Kapitalallokation mit den betriebswirtschaftlichen und aufsichtsrechtlichen Aspekten der Asset Allokation im Fokus.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung im Themenbereich Asset Allokation ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie sind mit dem zentralen Grundlagenwissen zum Themenkomplex Kapitalallokation und Integration in den Strategie- und Steuerungsprozess vertraut.
- Sie kennen den Prozess von der Vermögensbilanzerstellung über die Parametrisierung zur Risiko- und Optimierungsanalyse.
- Sie sind in der Lage, Optimierungsimpulse zu interpretieren und mögliche Maßnahmen für die Sparkasse abzuleiten.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Frank Blass, PPI AG
- Christoph Bleses, PPI AG
- Dr. Michael Lesko, PPI AG
- Carsten Thewes, SVWL

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

2 Tage

PREIS

750,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einordnung in den strategischen Kontext

- Geschäftsstrategie und Risikostrategie
- Abgrenzung zur Risikotragfähigkeit
- Prozess und Abhängigkeiten der Asset Allokation im Überblick

Vermögensbilanz als Ausgangsbasis der Asset Allokation

- Vermögensbilanz und HGB-Bilanz
- Vermögensbilanz und ökonomisches Risikodeckungspotenzial
- Definition und Abgrenzung von Assetklassen
- Abbildung Zinsbuch und Durationsgewichtung bei Rentenklassen
- Bruttomethode und Nettomethode

Parametrisierung

- Performancezeitreihen als Datengrundlage der Parametrisierung
- Statistische Grundlagen der Zeitreihenanalyse und zentrale Kennzahlen (Performancemaße, Risikomaße, Abhängigkeitsmaße)
- Vorgehensweise bei der Festlegung der Parametrisierung

Risikoaggregation

- Grundlagen des Korrelationsmodells
- Vergleich und Unterschiede zwischen der Asset Allokation und der ökonomischen Risikotragfähigkeit bei der Risikoaggregation
- Integrierbare vs. additive Risikoklassen
- Praxisbeispiel: Ist-Risiko in der Asset Allokation

Optimierungsanalysen

- Zielfunktionen der Optimierung (Zielperformance, Zielrisiko, RORAC)
- Berücksichtigung von Nebenbedingungen (u. a. Zinsbuchhebelfaktor, Ober- und Untergrenzen, Allokierbarkeit, individuelle Präferenzen und Rahmenbedingungen)
- Optimierungsverfahren
- Effizienzanalysen und Risk-Return-Kennzahlen
- Grundidee der Optimierungsrechnung
- Ergebnisse und Interpretation der Optimierungsanalysen
- Ableitung der optimalen Zinsrisikodosis (Barwert und Hebelfaktor)
- Stabilität und Eigenschaften des Optimums

Integrierte Ergebnisanalysen

- Verzahnungen zur ökonomischen Risikotragfähigkeit
- Verzahnungen zur normativen Perspektive (Bilanz, GuV, BFA3, Kapitalplanung)
- Abhängigkeiten und Auswirkungen auf die aufsichtsrechtlichen Zinsrisikokennzahlen (u. a. IRRBB, SREP Zins, SREP weitere wesentliche Risiken, LCR, RWA)

Umsetzung der Asset Allokation

- Wege zur Erreichung der Soll-Allokation
- Grundideen für die fortlaufende Steuerung (Steuerungskreislauf)
- Umsetzungsmaßnahmen (derivativ vs. bilanzwirksam, liquide vs. illiquide, Direktbestand vs. Fonds)
- Managementstil und Abweichungsrisiko
- Rebalancing
- Regelmäßige und anlassbezogene Überprüfung

Zusammenfassung und Ausblick

Grundlagen der Banksteuerung – Anwenderschulung ic.asset.allokation

Die Anwendung ic.asset.allokation unterstützt Sparkassen gezielt bei der strategischen Kapitalallokation. Sie ermöglicht die eigenständige Analyse der bestehenden Asset-Allokation auf Basis der Vermögensbilanz. Hieraus kann die Ableitung potenzieller Handlungsmaßnahmen zur Optimierung der Allokation erfolgen. Die optimale Nutzung der Anwendung wird in dieser Veranstaltung vermittelt.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung (insbesondere für die Anwendung der Software ic.asset.allokation) ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie können die erlernten Grundlagen in der Praxisanwendung der Software ic.asset. allokation umsetzen.
- Sie kennen die unterschiedlichen Funktionalitäten und Auswertemöglichkeiten.
- Sie sind durch die vorgestellten Beispiele in der Lage, Analysen in der Sparkasse durchzuführen.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Carsten Thewes, Sparkassenverband Westfalen-Lippe
- Marcel Lin, S Rating und Risikosysteme GmbH

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Gesamtüberblick

Konfiguration

- Anlage von Risikoklassen und Vermögenspositionen
- Erfassung der RWA-Parameter
- Erfassung der LCR-Parameter

Pflege der Vermögensbilanz

- Eingabe Zinsbuch
- Erfassung weiterer Vermögenspositionen
- Erfassung der RWA

Zeitreihenanalyse und Parameterschätzung

- Einstellungen für die Zeitreihenanalyse
- Import der Performancezeitreihen
- Analyse und Ermittlung von Kennzahlen
- Risiko- und Limitparameter (Performance und Risiko)
- Korrelationen
- Datenübernahme und Einstellungen

Analyse der Ist-Allokation

- Risikoübersicht
- Detailanalyse Zinsrisiko
- RWA-Ergebnisse
- Stabilitätstest

Optimierungsanalyse

- Optimierungskriterien
- Nebenbedingungen (maximale Umschichtung, Ober- und Untergrenzen, Allokierbarkeit, Zinsbuchhebel, Gesamtbankhebel, RWA-Nebenbedingungen)
- Optimierungsverfahren (mathematisch vs. alle Kombinationen)
- Ergebnisse der Optimierung und Top-Liste
- Detailanalyse Zinsrisiko
- RWA-Ergebnisse
- Ergebnisse LCR
- Stabilitätstest
- Szenariovergleich

Zusammenfassung und Ausblick

Grundlagen der Banksteuerung – Risikoinventur inklusive Nachhaltigkeitsrisikoinventur (online)

In diesem Grundlagenseminar stehen die aufsichtsrechtlichen Anforderungen an die Risikoinventur sowie die Analyse der Risikokonzentrationen gemäß MaRisk im Fokus. Sie erhalten Einblicke in die Umsetzung in der Sparkassen-Finanzgruppe auf Basis des Praxisleitfadens Risikoinventur.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Risikocontrolling bzw. der Banksteuerung, die für eine Tätigkeit im Themenbereich Risikoinventur ausgebildet werden sollen

IHR NUTZEN

- Sie sind mit dem Standardvorgehensmodell der Risikoinventur in der Sparkassen-Finanzgruppe vertraut.
- Sie kennen die Funktionsweise der Erfassungshilfe zur Risikoinventur in Caballito und können diese Anwendung in der Sparkassenpraxis nutzen.
- Sie haben grundsätzliche Kenntnisse der zusätzlichen Anforderungen an die Betrachtung einer längerfristigen Perspektive im Rahmen der (strategischen) Nachhaltigkeitsrisikoinventur.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Sascha Lagenstein, Ostdeutscher Sparkassenverband
- Sebastian Siegmund, Ostdeutscher Sparkassenverband

HINWEIS(E)

Diese Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten. Sie wird von der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie durchgeführt.

Anmeldungen für diese Veranstaltung nehmen Sie bitte direkt über die Nord-Ostdeutsche Sparkassenakademie vor. Ausführliche Informationen (z. B. zum Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit zu den beiden Terminen in 2026 finden Sie im Buchungsportal der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie über folgende Links:

- 04.05.2026: Veranstaltungsdetailseite - Veranstaltungen - weitere Seiten - Nord-Ostdeutsche Sparkassenakademie
- 17.09.2026: Veranstaltungsdetailseite - Veranstaltungen - weitere Seiten - Nord-Ostdeutsche Sparkassenakademie

Ihre Ansprechpartnerin bei der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie ist Frau Luise Harder, Mail: luise.harder@nosa-online.de.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einführung in die aufsichtsrechtlichen Anforderungen an die Risikoinventur sowie die Analyse der Risikokonzentrationen gemäß MaRisk

Darstellung des Standardvorgehensmodells der Risikoinventur in der Sparkassen-Finanzgruppe

Erläuterung zu den Wesentlichkeitsprüfungen in den einzelnen Risikokategorien

Darstellung der Anforderungen zur Nachhaltigkeitsrisikoinventur in der operativen und strategischen Perspektive

Darstellung des Standardvorgehensmodells der Identifikation von Risikokonzentrationen in der Sparkassen-Finanzgruppe

Hinweise zur Ermittlung von Ertragskonzentrationen

Vermittlung der grundlegenden Funktionsweise zur Erfassung der Risikoinventur inklusive Risikokonzentrationen in der Caballito-Erfassungshilfe

Erfolgreicher Aufbau der Geschäftsfeldsteuerung in der Sparkasse

Die Überführung der Erkenntnisse der Erfolgsanalyse Kundengeschäft (EAK) in operative Maßnahmen und die Verbindung zur Planung stellt für viele Sparkassen eine Herausforderung dar. Die Implementierung einer Geschäftsfeldsteuerung in der Sparkasse kann hierbei als "Brücke" zwischen strategischer Analyse und operativer Umsetzung bis zur Zielkarte im Vertrieb dienen. Dieses Unterstützungsangebot begleitet die Prozesse zur Erstellung einer Geschäftsfeldplanung in Ihrer Sparkasse.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen und Führungskräfte aus den Bereichen Gesamtbank- und Vertriebssteuerung, die eine Geschäftsfeldsteuerung in ihrer Sparkasse aufbauen möchten

IHR NUTZEN

- Sie erarbeiten im Projektkickoff die gemeinsame Zielsetzung und den Umsetzungsfahrplan für den Aufbau der Geschäftsfeldsteuerung.
- Sie führen mit einem Expertenteam einen S-DWH-Check durch, identifizieren Gaps und erhalten Handlungsempfehlungen zu deren Schließung.
- Sie bauen das Reporting für die Umsetzung auf, definieren Prozesse für den Regelbetrieb und setzen die Planungsrechnung GBS VMU um.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Robert Budde, SVWL und/oder Michael Biella, RSGV
- Mitarbeiter/-innen der CP Consultingpartner AG

HINWEIS(E)

Dieses Unterstützungsangebot wurde im Rahmen der "Informationsveranstaltung Geschäftsfeldsteuerung: Inhalte, Eingangsvoraussetzungen und Einführungsangebot" detailliert erläutert. Die Umsetzung erfolgt im Rahmen von Kleinserien mit jeweils maximal vier Sparkassen. Die Termine finden vor Ort in der Sparkasse, in Webex-Onlinekonferenzen und in der Sparkassenakademie NRW statt. Die Anmeldung im Akademieportal erfolgt ausschließlich auf eine vom Sparkassenverband vorab zugeordnete Serie.

Bei Interesse an einer Teilnahme nehmen Sie – sofern noch nicht erfolgt – bitte als SVWL-Sparkasse Kontakt mit Herrn Robert Budde (Mail: r.budde@svwl.eu) bzw. als RSGV-Sparkasse mit Herrn Michael Biella (Mail: michael.biella@rsgv.de) auf.

TERMIN(E)

2604_Serie_3 | 13.05.2026 – 30.10.2026 | Sparkassenakademie NRW

Kick-Off (13.05.2026)
Reporting (01.07.2026)

DAUER

9 Tage

PREIS

Gesamtpreis 19.750 € je Sparkasse

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Vorstandsinterview

- Vorstellung Projekt
- Abklärung der Erwartungen der Führungsebene

Kick-Off

- Vorstellung der Zielsetzung
- Umsetzungsfahrplan
- Aufzeigen interner Kapazitäten und Skills

Check

- Check: S-DWH, KORE, GBS
- Identifikation von Gaps und Handlungsempfehlungen zur Schließung

Methoden und Verfahren

- Festlegung der Methoden zur Leistungs- und Kostenverrechnung
- Aufstellung Produkt- und OE-Sicht

Reporting

Aufbau Reporting für Umsetzung und Regelbetrieb

Umsetzung und Prozesse

- Umsetzung der Methoden und Verfahren
- Prozesse für Regelbetrieb

Umsetzung Planungsrechnung GBS VMU

Workshop Führungsprozesse

Abschluss

- Interne Kommunikation
- Weitere Schritte

Ganzheitliche Kapitalanlagestrategie für Langfristinvestoren

Diese Veranstaltung bietet Einblicke in den Maschinenraum eines Langfristinvestors beim Management großer Kapitalanlageportfolios. Dabei werden die Zusammenhänge und Wechselwirkungen von Kapitalanlagestrategie, Asset Management und Bilanzierung thematisiert. Profitieren Sie von Impulsen für die Eigenanlagen der Sparkasse oder für Ihre Beratungsgespräche.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Gesamtbanksteuerung, Treasury und Private Banking mit Interesse an der ganzheitlichen Steuerung und Betreuung von Portfolios

IHR NUTZEN

- Sie gewinnen einen Überblick über die Vorgehensweise und die Methoden eines Langfristinvestors beim Management großer Kapitalanlageportfolios.
- Sie können anschließend die Zusammenhänge und Wechselwirkungen von Kapitalanlagestrategie, Asset Management und Bilanzierung nachvollziehen.
- Sie sind mit den verschiedenen Steuerungsebenen und -möglichkeiten des Kapitalanlagemanagements vertraut und können diese gewinnbringend nutzen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Kenntnisse über die grundsätzlichen Zusammenhänge der Kapitalanlage

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Spezialistinnen und Spezialisten der Provinzial Asset Management GmbH (ProAM) aus den Bereichen Investment Client Solutions, Strategie, Volkswirtschaft & Portfolio Management

HINWEIS(E)

Die Kosten für den Besuch dieser Veranstaltung werden von der Provinzial Asset Management GmbH (ProAM) übernommen.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag
09:30 - 16:00 Uhr

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Verzahnung von Kapitalanlagestrategie, Asset Management und Bilanzierung

- Strategische Asset Allokation (SAA) als elementarer Werttreiber
- Volkswirtschaftliche Analysen als Ausgangsbasis für die "Taktische Asset Allokation" (TAA)
- Umsetzung im Asset Management über Direktbestandsmanagement und innovative Fondskonzepte anhand von Beispielen
- Anwendung von Bilanzierungsmöglichkeiten zur Erhöhung der Portfoliostabilität
- Nutzung der Erfahrung als Langfristinvestor auch für Kundinnen und Kunden außerhalb des Provinzial-Konzerns

Vertiefungsschulung Gesamtbanksimulation (GBS) - Bewertungsergebnis Wertpapiere, Fondsplanung und BFA-3-Simulation

In dieser Veranstaltung vertiefen Sie die methodischen Grundlagen der GBS im Hinblick auf die Ermittlung des Bewertungsergebnisses im Wertpapiergeschäft, die Fondsplanung und die BFA-3-Simulation. Sie werden in der Veranstaltung durch die Anwendung geführt und es werden Eingabeerfordernisse und Wirkungsketten aufgezeigt.

ZIELGRUPPE

Neueinsteiger/-innen, die bereits das Seminar "Grundlagen der Banksteuerung – GBS VMU: methodische und anwendungsbezogene Grundlagen normative Perspektive der RTF" (Angebotsnummer 30.235) besucht haben und erfahrene Mitarbeiter/-innen, die ihr Wissen auffrischen und vertiefen wollen

IHR NUTZEN

- Sie kennen die methodischen Grundlagen zur Ermittlung des Bewertungsergebnisses im Wertpapiergeschäft, der Fondsplanung und des BFA-3-Saldos (Forward- und Stichtagssicht) und können die Wirkungszusammenhänge nachvollziehen.
- Sie sind in der Lage, die erforderlichen Eingaben für Bewertungsergebnis, Fondsplanung und BFA-3-Simulation in GBS korrekt und vollständig vorzunehmen.

IHR REFERENT

David Mulaj, PPI AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten. Ausführliche Informationen (z. B. Termin/e und Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen über folgenden Link: Buchungsportal Hessen-Thüringen

Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Methodische Grundlagen

- Ermittlung Bewertungsergebnis Wertpapiergeschäft
- Fondsplanung (Teilszenario der Planung)
- BFA 3: Stichtags- und Forwardsicht

Anwenderbezogene Grundlagen

- Eingaben Fondsplanung (Teilszenario der Planung)
- Eingaben für das Bewertungsergebnis Wertpapiergeschäft
- Eingaben BFA 3 (Stichtags- und Forwardsicht)

Vertiefungsschulung Gesamtbanksimulation (GBS) - Ergebnisspaltung, virtuelle Kasse und Planung

In dieser Veranstaltung vertiefen Sie die methodischen Grundlagen der Ergebnisspaltung und können die Ergebnisbeiträge interpretieren. Darüber hinaus wird das Konzept und die Funktion der virtuellen Kasse in GBS thematisiert. Sie profitieren von zahlreichen Praxistipps zum besseren Handling von GBS.

ZIELGRUPPE

Neueinsteiger/-innen, die bereits das Seminar "Grundlagen der Banksteuerung – GBS VMU: methodische und anwendungsbezogene Grundlagen normative Perspektive der RTF" (Angebotsnummer 30.235) besucht haben und erfahrene Mitarbeiter/-innen, die ihr Wissen auffrischen und vertiefen wollen

IHR NUTZEN

- Sie verstehen die methodischen Grundlagen der Ergebnisspaltung und können die Ergebnisbeiträge interpretieren.
- Sie sind mit dem Konzept und der Funktion der virtuellen Kasse in GBS vertraut.
- Sie kennen wichtige GBS-Besonderheiten (z. B. Zinsabstimmung) und können typische Abstimmungsdifferenzen identifizieren und auflösen.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- David Mulaj, PPI AG
- Sabine Kosteletzky, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten. Ausführliche Informationen (z. B. Termin/e und Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen über folgenden Link: Buchungsportal Hessen-Thüringen

Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Methodische und anwenderbezogene Grundlagen der Ergebnisspaltung und der virtuellen Kasse

Wichtige Hinweise zu Besonderheiten in GBS (z. B. Zinsabstimmung)

Praxistipps zum besseren Handling von GBS

Vertiefungsschulung Gesamtbanksimulation (GBS) - Kapital- und RWA-Planung

In dieser Veranstaltung vertiefen Sie die regulatorischen Rahmenbedingungen der normativen RTF und die Anforderungen an die Kapitalplanung. Die methodischen und anwenderbezogenen Grundlagen zur Simulation der Kapitalien und der RWA stehen dabei im Fokus. Profitieren Sie von Praxishinweisen, um die die erforderlichen Eingaben zur Simulation eigenständig vornehmen zu können.

ZIELGRUPPE

Neueinsteiger/-innen, die bereits das Seminar "Grundlagen der Banksteuerung – GBS VMU: methodische und anwendungsbezogene Grundlagen normative Perspektive der RTF" (Angebotsnummer 30.235) besucht haben und erfahrene Mitarbeiter/-innen, die ihr Wissen auffrischen und vertiefen wollen

IHR NUTZEN

- Sie kennen die regulatorischen Rahmenbedingungen der normativen RTF und können die Anforderungen an die Kapitalplanung einordnen.
- Sie verstehen die methodischen Grundlagen zur Simulation der Kapitalien und der RWA in GBS.
- Sie sind in der Lage, die erforderlichen Eingaben zur Simulation der Kapitalien und RWA eigenständig vorzunehmen.

IHR REFERENT

David Mulaj, PPI AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten. Ausführliche Informationen (z. B. Termin/e und Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen über folgenden Link: Buchungsportal Hessen-Thüringen

Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Regulatorische Rahmenbedingungen der normativen RTF

Methodische Grundlagen zur Simulation der Kapitalien und RWA

Anwenderbezogene Grundlagen zur Simulation der Kapitalien und RWA

Grundlagen der Banksteuerung – Immobilienpreisrisiko in der ökonomischen Sicht

Die Messung des ökonomischen Immobilienpreisrisikos erfolgt derzeit auf der S-Rating-Plattform caballito. Mit dem Rollout der neuesten Anwendung gab es umfassende Anpassungen an der Lieferstrecke der Portfolio- und Marktdaten sowie im Rechenkern selbst. Zudem wurden weiterführende Anpassungen durch die SR an den dezentral von den Sparkassen durchzuführenden Validierungshandlungen vorgenommen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen des Controllings bzw. Risikocontrollings, die für die Steuerung des ökonomischen Immobilienpreisrisikos in caballito verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen und methodischen Hintergründe zur Ermittlung des ökonomischen Immobilienpreisrisikos.
- Sie sind mit den dezentral durch die Sparkasse durchzuführenden Validierungshandlungen im Rahmen der jährlichen Institutsvalidierung vertraut.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Florian Gruber (SVN)
- Tobias Schäffner (SGVHT)

HINWEIS(E)

Fachliche Grundlage der Veranstaltung sind die zentralen Schulungs- sowie Validierungsunterlagen der S-Rating zur Thematik.

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten. Ausführliche Informationen (z. B. zum Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal dieser Akademien.

Ihre Anmeldungen für den Termin 03.12.2026 erfolgen über die Sparkassenakademie Niedersachsen.
Link zur Anmeldung in Niedersachsen: Anmeldungen Niedersachsen
Ihre Ansprechpartnerin bei der Sparkassenakademie Niedersachsen ist Frau Petra Kauke, Mail: petra.kauke@svn.de.

Ihre Anmeldungen für den Termin 08.12.2026 erfolgen über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen.
Link zur Anmeldung in Hessen-Thüringen: Anmeldungen Hessen-Thüringen
Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Vermittlung der notwendigen fachlichen und methodischen Grundlagen sowie Definitionen

Theoretische Grundlagen zur Messung des ökonomischen Immobilienpreisrisikos

Überblick über die Datenstrecke

Konkrete praktische Umsetzungshinweise

Überblick über die dezentral durch die Sparkassen durchzuführenden Validierungshandlungen im Rahmen der jährlichen Institutsvalidierung

Rollout RKR 2.0 - Risikomodell zur Messung des ökonomischen Refinanzierungskostenrisikos (online)

In dieser Rolloutveranstaltung zum neuen Risikomodell zur Messung des ökonomischen Refinanzierungskostenrisikos (RKR 2.0) erhalten Sie Informationen zu den fachlich-methodischen Hintergründen und zur Parametrisierung des neuen Modells.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die in der Sparkasse das Thema Refinanzierungskostenrisiko betreuen und bislang für die Anwendung IDH-LQR-RKR zuständig sind.

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachliche Neuausrichtung des Refinanzierungskostenrisikos in der Sparkassen-Finanzgruppe.
- Sie sind mit den fachlich-methodischen Hintergründen, der Parametrisierung sowie technischen Anwendungsfällen zur Messung des Refinanzierungskostenrisikos im neuen Verfahren vertraut.
- Sie können die neuen Methoden des RKR in Ihrer Sparkasse anwenden.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Melanie Schmacht, RSGV
- Karsten Rauch, SGVHT

HINWEIS(E)

Ergänzend werden nachgelagert regionale Erfahrungsaustausche angeboten. Weitere Informationen erhalten Sie über den jeweiligen Regionalverband.

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Sparkassenakademie Niedersachsen angeboten.

Ein weiterer (inhaltlich identischer) Termin dieser Veranstaltung wird am 19. November 2026 (in der Zeit von 09:00 - 13:00 Uhr) über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten.

Anmeldungen für diesen Termin sind über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen vorzunehmen.

Zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen gelangen Sie über folgenden Link: Buchungsportal Hessen-Thüringen

Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, E-Mail: matthias.korte@sgvht.de

TERMIN(E)

23.11.2026 | virtueller Seminarraum
13:00 – 17:00 Uhr

DAUER

4 Stunden

PREIS

295,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Neuausrichtung RKR - Hintergründe und Einordnung in das RTF-Konzept

Refinanzierungskostenrisiko in der ökonomischen RTF

Modellüberblick: Grundlagen Risikowertermittlung

Ausgestaltung RKR-Szenario

Durchführung Risikorechnung (in GBS) und Überführung der Risikowerte in die ökonomischen RTF

30 BANKSTEUERUNG

Kalkulation

S-Datawarehouse - Grundlagen (S605)

Das S-Datawarehouse ist ein komplexes Datenbanksystem, dessen Inhalt sich aus Daten unterschiedlicher Quellen zusammensetzt. In diesem Seminar lernen Sie die grundlegenden Funktionen des S-Datawarehouse kennen.

ZIELGRUPPE

(Neue) Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Gesamtbanksteuerung, Betriebswirtschaft, Controlling, Rechnungswesen und Organisation, die ein grundlegendes Verständnis zu den Abläufen und Ergebnissen des S-Datawarehouse benötigen

IHR NUTZEN

- Sie sind vertraut mit den Grundlagen der Anwendungen und Funktionen des S-Datawarehouse (Fokus Vertriebscontrolling).
- Sie verfügen über Grundkenntnisse der Abläufe und Ergebnisse des S-Datawarehouse.
- Sie können einzelne Anwendungen anhand praxisnaher Beispiele direkt am PC testen.

IHR REFERENT

Daniel Jedamzik, CP Consultingpartner AG

Managing Consultant mit langjährigen Erfahrungen im Flexiblen Reporting sowie dem S-DWH inkl. Änderungsdienst

TERMIN(E)

25.05.2027 – 26.05.2027 |
Sparkassenakademie NRW

DAUER

2 Tage

PREIS

820,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Bedeutung und Funktion des S-DWH

Einbettung des S-DWH in die OSPlus-Banksteuerung

Daten – Strukturen – Regeln

- Datenfluss - Schnittstellen - Monatsaufbau - Gültigkeit
- Stammdaten - Bestandsdaten - Bewegungsdaten - Verbundpartnerdaten
- Objektarten im S-DWH
- Offene Schnittstelle
- Global- und Individualdaten
- Institutsregeln

Ableitung der Daten aus dem operativen System

- Umschlüsselungen
- Grundzüge der Produktermittlung (VPE und VPE AZ6)

Grundlagen der Rechtesteuerung und Berichtsverteilung

Der Änderungsdienst als Schaltzentrale

Demonstration von Beispielen

„Nice to know“

S-DWH Check-up – Qualitätssicherung für Kalkulation und Steuerung

Das S-DWH bleibt die übergreifende Datenbasis für Kalkulation, Risikosteuerung und Reporting. Die Qualität der Daten ist dabei entscheidend für verlässliche Steuerungsinformationen. Eine falsche oder unvollständige Datenverarbeitung im S-DWH führt zu fehlerhaften Ergebnissen im Berichtswesen. Dieser S-DWH Check-up zeigt den Status quo in Ihrer Sparkasse auf. Es werden zielgenaue Maßnahmen abgeleitet und Lösungen erarbeitet, um zukünftig vollständige und verlässliche Kennzahlen/Berichte für Gesamtbank und Vertrieb zu erhalten.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Kalkulation sowie Gesamtbank- und Vertriebssteuerung, die in der Sparkasse Daten im S-DWH verarbeiten/nutzen

IHR NUTZEN

- Sie sind mit dem aktuellen Stand der Readiness für verschiedene S-DWH-Anwendungszwecke in Ihrer Sparkasse vertraut.
- Sie sind in der Lage, in Zusammenarbeit mit erfahrenen Expertinnen und Experten zielgenaue Maßnahmen zur Optimierung für Ihre Sparkasse abzuleiten.
- Sie können nach dem Check-up die Anwendung S-DWH im aktuellen Reporting und in zukünftigen Lösungen (insbesondere IDH-Reporting) für Kalkulation, Banksteuerung, Kundengeschäftscontrolling und Vertrieb nutzen.

IHR REFERENT

Mitarbeiter/-innen der CP Consultingpartner AG

HINWEIS(E)

Der S-DWH Check-up wird individuell je Sparkasse als Inhouse-Maßnahme angeboten. Die Termine für das Interview (Durchführung als digitaler Termin oder als Präsenztermin in der Sparkasse möglich) und die Umsetzungsempfehlungen (Durchführung als digitaler Workshop) werden nach Absprache mit Ihrem Institut vereinbart. Es finden keine Termine in der Sparkassenakademie statt.

Bei Interesse an einer Teilnahme am S-DWH Check-up senden Sie bitte eine Mail mit Angabe Ihrer Durchführungspräferenz für das Interview an robert.schulze@ska.nrw und in Kopie an christina.temmen@ska.nrw.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

4 Stunden

PREIS

Preis je Sparkasse: 3.450,00 € (ggf. zzgl. Fahrtkosten)

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Bestandteile des S-DWH Check-ups:

Interview – (digitaler) Workshop

- Termin vor Ort oder digital (mit Abfrage technischer Einstellungen)
- Angaben über aktuelle Nutzung der FI-Systeme sowie Einsatz von Drittanwendungen
- Dauer: ca. 2 Stunden

Analyse durch CP (Identifikation der Handlungsfelder)

- Dokumentation und Darstellung von Ist-Zustand, Zielbild, Gaps und Maßnahmen
- Vorgeschlagene Lösungen entsprechen den FI/SR-Standards bzw. Best-Practices von Sparkassen
- Detailbetrachtung von vier Handlungsfeldern
  - Parametrisierung
  - Datenstrukturen
  - Kalkulation
  - Reporting/Steuerungsimpulse

Umsetzungsempfehlung (Bereitstellung der Ergebnisse) – digitaler Workshop

- Zeitliche Ausgestaltung und Priorisierung der Themen
- Individuelle Umsetzungsempfehlung der Maßnahmen
- Dauer: ca. 2 Stunden

Auf Basis der Ergebnisse aus den Interviews und Identifizierung der Handlungsfelder werden zu einem späteren Zeitpunkt ggf. weitere Umsetzungsangebote durch die Akademie angeboten.

S-Datawarehouse - Funktionen des Änderungsdienstes für Administratoren (S606) (online)

Das komplexe Datenbanksystem S-Datawarehouse ist die Grundlage für vier Anwendungsbereiche (Verkaufscontrolling, Produktivität, Marketing und Risiko). Alle Module nutzen gemeinsam die Anwendung "Änderungsdienst" zur Online-Pflege der Datawarehouse-Objekte. Der Änderungsdienst ist eine Großrechneranwendung, mit deren Hilfe die aktuellen, historischen und für die Zukunft geplanten Daten online bearbeitet werden können. Für Administratorinnen und Administratoren bieten wir dazu diese Veranstaltung an.

ZIELGRUPPE

(Neue) Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Organisation und Administratorinnen /Administratoren, die einen Einblick in die Aufgaben und Funktionalitäten des S-Datawarehouse-Änderungsdienstes benötigen

IHR NUTZEN

- Sie sind vertraut mit den administrativen Funktionen des Änderungsdienstes im S-Datawarehouse (exkl. spezielle Kalkulationsvorgaben).
- Sie kennen Objektarten, Strukturen, die Datenübergabe sowie die Aggregation der Daten und wesentliche Steuerungsparameter.
- Sie können Berechtigungen vergeben, anwendungsspezifische Einstellungen vornehmen, Standardvorgaben umsetzen und aufgabenorientierte Schritte planen.

IHR REFERENT

Daniel Jedamzik, CP Consultingpartner AG

Managing Consultant mit langjährigen Erfahrungen im Flexiblen Reporting sowie dem S-DWH inkl. Änderungsdienst

HINWEIS(E)

Sie benötigen während des Seminars Ihren sparkasseneigenen S -User und das dazugehörige aktuelle Passwort. Darüber hinaus werden Sie gebeten, sich für diese S-User kurzfristige Rechte für das Arbeiten mit dem Flexiblen Reporting und dem Änderungsdienst von Ihrer Sparkasse einrichten zu lassen. Die Rechte beginnen mit „EFB-…..“ und sind im KURS-Rechte-System zu vergeben. Nähere Erläuterungen finden Sie im FI-Kundenportal im Handbuch „Flexibles Reporting“ im Kapitel „Erforderliche Berechtigungen (KURS-Privilegien)“.

TERMIN(E)

01.06.2027 | virtueller Seminarraum

DAUER

1 Tag

PREIS

415,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Aufgaben und Funktionalitäten des Änderungsdienstes

Datenübergabe und Aggregation der Daten

Institutsregeln und Schlüssel

Objektarten und Strukturen

Erläuterungen zum Regelkatalog, z. B. Produktermittlung (Defaults) und institutsindividuelle Einstellungen (VPE)

Einzelwerte im S-DWH

Berechtigungen: Neuanlage der Benutzer; Referenz-User; Sonderberechtigungen

Anwendungsspezifische Einstellungen

Aufgabenorientierte ToDo-Listen

Grundlagen der zahlungsstromorientierten Kalkulation (zoK 1 - Basisfunktionalitäten)

Die zahlungsstromorientierte Kalkulation (zoK) umfasst die Nachkalkulation des zinstragenden Kundengeschäfts und dient somit als zentrale Informationsbasis einer wertorientierten Banksteuerung. In dieser Veranstaltung werden die wesentlichen Methoden der zoK vermittelt.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen im Themenbereich Nachkalkulation/OSPlus-Banksteuerung

IHR NUTZEN

- Sie kennen die wesentlichen Methoden der zahlungsstromorientierten Kalkulation.
- Sie sind mit Informationen zur Parametrisierung im S-DWH-Änderungsdienst vertraut.
- Sie können zoK-Reports mithilfe der Anwendung "Nachkalkulationsanalyse" bearbeiten.

VORAUSSETZUNG(EN)

Fachliche Kenntnisse in der Kalkulation von Zinsgeschäften (Effektivzinsermittlung und Bruttomargenkalkulation) sind erwünscht.

IHRE REFERENTIN

Erika Knack, msg for banking ag

TERMIN(E)

11.11.2026 | Sparkassenakademie NRW

DAUER

1 Tag

PREIS

450,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Vermittlung der grundlegenden Methoden der zahlungsstromorientierten Kalkulation

- Tägliche Verarbeitung des Festzinsgeschäfts
- Monatliche Verarbeitung des variablen Geschäfts

Ermittlung der Ergebnisgrößen

- Zinskonditionenbeitrag vor Liquidität
- Gedeckter bzw. ungedeckter Liquiditätsspread
- Schaden/Nutzen
- Barwertiger Margen- und Liquiditätsbeitragsausgleich

Maschinelle und manuelle Korrekturverfahren im Kontext der Margen- und Liquiditätsbeitragsermittlung

Funktionsweise und Einsatzgebiete der zoK-gestützten Basiskalkulation (zoKB)

Parametrisierung der Margen- und Liquiditätsbeitragsermittlung im S-DWH-Änderungsdienst mit Exkurs zur Parametrisierung des variablen Geschäfts im IDH

Bedeutung und Nutzung der Anwendung "Nachkalkulationsanalyse" zur kontinuierlichen Verbesserung der zoK-Datenqualität

Hinweise zur Ergebnisüberleitung an das OSPlus-Vertriebscontrolling/die OSPlus-Banksteuerung und an den IDH

Zahlungsstromorientierte Kalkulation (zoK 2 - Besonderheiten und optionale Komponenten)

Die zahlungsstromorientierte Kalkulation umfasst die Nachkalkulation des zinstragenden Kundengeschäfts und dient somit als zentrale Informationsbasis einer wertorientierten Banksteuerung. In diesem Seminar werden die über die einfache Margen- und Liquiditätsbeitragsermittlung hinaus gehenden Funktionalitäten der zahlungsstromorientierten Kalkulation erläutert.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen im Themenbereich Nachkalkulation/OSPlus-Banksteuerung

IHR NUTZEN

- Sie sind mit den über die einfache Margen- und Liquiditätsbeitragsermittlung hinausgehenden Funktionalitäten der zahlungsstromorientierten Kalkulation vertraut.
- Sie haben Kenntnisse zur Ermittlung sowie Parametrisierung von Options- und Risikoprämien.
- Sie lernen besondere Sachverhalte in der Nachkalkulation sowie die Nutzung der periodischen Ausgleichszahlung (AGZp) kennen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Grundlagenkenntnisse zur zahlungsstromorientierten Kalkulation, wie sie z. B. im Seminar "Grundlagen der zahlungsstromorientierten Kalkulation (zok 1 - Basisfunktionalitäten)" mit der Angebotsnummer 30.325 vermittelt werden.

IHRE REFERENTIN

Erika Knack, msg for banking ag

TERMIN(E)

12.11.2026 | Sparkassenakademie NRW

DAUER

1 Tag

PREIS

450,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Implizite Optionen in der Nachkalkulation mit Exkurs zur Parametrisierung im IDH

Verwendung der Ergebnisse aus der Sicherheitenverrechnung in der Nachkalkulation

Ermittlung von Bonitätsprämien durch die Nachkalkulation

Berechnung der periodischen Ausgleichszahlungen mit Exkurs zur Parametrisierung des variablen Geschäfts im IDH

Kalkulation besonderer Sachverhalte

- Roll-Over-Verträge
- Weiterleitungsdarlehen
- Eigengeschäfte in der AZ2/AZ6
- Fremdwährungsverträge
- Eigenemittierte Wertpapiere
- Vorterminierte Zinsvereinbarungen

Optionskosten in der Vor- und Nachkalkulation

Ziel des Seminars ist zum einen die Wissensvermittlung der erforderlichen Kenntnisse im Themenbereich "Implizite Optionen" in Ihrer Sparkasse. Zum anderen erfolgt die Vorstellung der Möglichkeiten zur Parametrisierung der Vor- und Nachkalkulation im Bereich der Optionsprämienermittlung für die "Impliziten Optionen" im Kundengeschäft.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die bereits über Vorkenntnisse in der Produktkalkulation und/oder Parametrisierung von MARZIPAN bzw. der zahlungsstromorientierten Nachkalkulation verfügen und diese hinsichtlich der Optionskostenberechnung vertiefen möchten.

IHR NUTZEN

- Sie kennen die thematisch relevanten Nutzungsmöglichkeiten in der OSPlus-Banksteuerung.
- Sie sind mit Hinweisen auf die Zusammenhänge zwischen der Kalkulation und AnimO im IDH vertraut.
- Sie können eine zwischen Vor- und Nachkalkulation konsistente Ergebnisermittlung in der Sparkasse umsetzen.

IHRE REFERENTIN

Alexa Bell, msg for banking ag

Managerin mit den Kernthemen Kalkulationsmanagement, Vor-/Nachkalkulation, Vertriebsplanung, Vertriebscontrolling und Reporting

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

450,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Was sind "Implizite Optionen"? Erläuterung anhand gängiger Vertragsgestaltungen

Bedeutung "Impliziter Optionen" in der Kalkulation

Darstellung der Zusammenhänge Vor- und Nachkalkulation, Vertriebs-, Gesamtbank- und Risikosteuerung – Sicherstellung der Konsistenz

Übersicht Datenfluss und Datenqualität in der OSPlus-Banksteuerung

Differenzierung des Ausübungsverhaltens (statistisch, optional, eingeschränkt optional)

Beschreibung des Ausübungsverhaltens über eine Ausübungsfunktion

Möglichkeiten der Parametrisierung in der Vorkalkulation sowie Hinweise für die Parametersetzung in der Nachkalkulation über AnimO (u. a. Optionspreismodell, Zinsvolatilitäten, Funktion, Schwellwerte, Barwertsicherung)

Auswirkung auf die Bewertung außerplanmäßiger Ereignisse in der Nachkalkulation

Diskussion anhand von Praxisfällen

Risikoadjustierte Prämienbestimmung (RAP) in der Nachkalkulation

Mit der Umstellung der PWB-Ermittlung von CPV auf den RAP-Rechenkern zum 31.12.2026 und der darauffolgenden Einführung des PWB-Anrechnungsverfahrens entsteht ein stärkeres Augenmerk auf die richtige Administrierung des RAP-Rechenkerns und die Plausibilisierung der Ergebnisse in der Nachkalkulation. Mit dem Besuch dieser Veranstaltung profitieren Sie von konkreten Hinweisen für die Umsetzung in der Praxis.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus den Fachbereichen Controlling, Risikocontrolling, Betriebswirtschaft und Vertriebscontrolling, die für die Ermittlung der Bonitätsprämie und für das neue PWB-Anrechnungsverfahren verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen und methodischen Hintergründe zur Ermittlung der Risikokosten in der RAP-Nachkalkulation.
- Sie können die Ergebnisse aus dem RAP-Rechenkern verifizieren und plausibilisieren.
- Sie profitieren von konkreten Hinweisen für die Umsetzung in der Praxis und sind auf die Nutzung des RAP-Rechenkerns in der PWB-Ermittlung vorbereitet.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Hendrick Hütten, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
- Ludger Trenkamp, Sparkassenverband Westfalen-Lippe
- Markus Walter, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten.

Weitere (inhaltlich identische) Termine dieser Veranstaltung werden am 23.06.2026 im S-Finanzzentrum in Erfurt und am 25.06.2026 online in Webex angeboten. Der Termin am 25.06.2026 (online in Webex) ist bereits ausgebucht. Anmeldungen für diese Termine nehmen Sie bitte direkt über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen vor. Zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen gelangen Sie über folgenden Link: Buchungsportal Sparkassenakademie Hessen-Thüringen

Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Zusammenspiel der Systeme (Vorkalkulationssystem MARZIPAN, zoK, OSPlus Kredit, VVS und S-DWH)

Administration S-DWH (RAP-Nachkalkulationsparameter und Institutsregeln, Pflege der Bewertungs- und Risikoklassifizierungen, SR-Steuerdaten)

Methodik RAP (Übersicht RAP-Parameter, Objektsicht und Berechnung der Bonitätsprämie)

Funktionsweise des S-DWH in der RAP-Nachkalkulation

- Sicherheitenverrechnungsmethode VQ-RAP, Fixierungsbeträge (RAP-Gedächtnis), B-Tage
- Unterschiede Festzins- zu variablem Geschäft
- Wirkung von Kalkulationsereignissen (z. B. NeuRisk)

Behandlung von Sonderfällen (Linien, KK, Avale)

Zusammenspiel RAP-Rechenkern und PWB-Anrechnungsverfahren

Datenqualitätsmanagement (erste Erkenntnisse aus dem PWB-Praxissprint)

Grundlagen der Kalkulation aktiv und passiv mit MARZIPAN (S592a)

Anhand praxisnaher Beispiele und Berechnungen lernen Sie in dieser Veranstaltung die grundlegenden Funktionalitäten der Vorkalkulation mit MARZIPAN kennen. Diverse Anwendungsfälle der Einzelkalkulation von Aktiv- und Passivprodukten werden im Seminar mittels vorkonfigurierter Beispielprodukte thematisiert und exemplarisch berechnet.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Kalkulation sowie aus anderen Bereichen, in denen Kredite auf Einzelgeschäftsbasis kalkuliert werden sollen

IHR NUTZEN

- Sie lernen die grundlegenden Funktionalitäten der Vorkalkulation mit MARZIPAN anhand praxisnaher Beispiele und Berechnungen kennen.
- Sie sind mit Anwendungsfällen der Einzelkalkulation von Aktiv- und Passivprodukten vertraut.

IHR REFERENT

Dr. Christoph Vogelsang, msg for banking ag

HINWEIS(E)

Die erforderlichen Kenntnisse zur Administration von MARZIPAN bzw. zur Produktkonfiguration sind nicht Bestandteil dieses Seminars. Diese werden in der Veranstaltung "Administration von MARZIPAN" (Angebotsnummer 30.386) vermittelt.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

2 Tage

PREIS

900,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Grundlagen der Bankkalkulation innerhalb der Konditionsfindung

Überblick der Anforderungen an das Pricing aus den MaRisk/EBA-Guidelines

Effektivzinsrechnung

- Effektivzinsberechnung nach PAngV (Wohnimmobilienkreditrichtlinie)
- Effektivzinsberechnung ICMA

Margenkalkulation

- Prinzip der strukturkongruenten Refinanzierung
- Einflussfaktoren auf die Margenkalkulation (Teilvalutierung, Sondertilgungen, Forward-Terminierung)
- Verwendung von Bewertungszinsen für die Kalkulation von variablen Produkten
- Renditeberechnung bei Anlagen

Deckungsbeitragsrechnung/Nettomargenkalkulation

- Verwendung eines mehrstufigen Deckungsbeitragsschemas zur Berechnung der Nettomarge
- Ermittlung von Kundenkonditionen unter Berücksichtigung von Options- und Risikokosten sowie weiteren kalkulatorischen Kostenelementen (z. B. Eigenkapitalkosten, Stückkosten, Gemeinkosten)

Kalkulation von Sonderformen der Finanzierung/Anlage

- Verträge mit vereinbartem Zinssatz-/Tilgungssatzwechsel
- Kalkulation von Zuwachssparen
- Kalkulation von Roll-Over-Darlehen
- Verträge mit abweichender Tilgungsverrechnung
- Berechnung einer Gesamtfinanzierung aus mehreren Finanzierungsbausteinen

Exemplarische Einbindung von MARZIPAN in einen Konditionen-/Kompetenzen-Prozess

Tableaukonfiguration in MARZIPAN (S594)

Mit den MARZIPAN-Tableaus steht den Sparkassen eine Funktionalität zur flexiblen Gestaltung von Konditionen- und Margentableaus zur Verfügung. Diese können sowohl zur Analyse und Überwachung einzelner Konditionenbestandteile in der Vertriebssteuerung als auch zur Ermittlung und Kommunikation von Konditionen für das Standardgeschäft genutzt werden. Darüber hinaus können die MARZIPAN-Tableaus automatisiert zur Nominalzinsermittlung innerhalb vieler Kreditprozesse in OSPlus angesprochen werden.

ZIELGRUPPE

Fachverantwortliche Mitarbeiter/-innen für Konditionen- bzw. Margentableaus sowie fachliche Administratorinnen und Administratoren von MARZIPAN (zum Beispiel aus den Bereichen Controlling, Organisation, Markt- und Vertriebssteuerung)

IHR NUTZEN

- Sie sind mit den Funktionalitäten zur Konfiguration von Konditionen- bzw. Margentableaus mit MARZIPAN vertraut.
- Sie lernen deren Anwendung anhand praxisnaher Übungsbeispiele kennen.
- Sie kennen die Einbindung der MARZIPAN-Tableaus in die OSPlus-Prozesse.

VORAUSSETZUNG(EN)

Fachliche Kenntnisse der Kalkulation mit MARZIPAN und gute Kenntnisse der Produktkonfiguration werden vorausgesetzt.

Die fachlichen Kenntnisse können im Rahmen der Seminars "Grundlagen der Kalkulation aktiv und passiv mit MARZIPAN (S592a)" (Angebots-Nr. 30.370) erworben werden. Kenntnisse zur Produktadministration werden im Rahmen der Veranstaltung "Administration von MARZIPAN" (Angebots-Nr. 30.386) vermittelt.

IHR REFERENT

Pascal Hintzen, msg for banking ag

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

450,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Nutzungsmöglichkeiten der Konditionen-/Margentableaus im Zuge von OSPlus_neo, OSPlus-Kredit und MARZIPAN Web (Stand-alone) und Abgrenzung zur Einzelkalkulation

Prozess zur Einführung von MARZIPAN-Tableaus und allgemeiner Überblick der technischen Zusammenhänge

Vorbereitende Tätigkeiten zur Tableau-Erstellung

- Vorzunehmende Anpassungen im Deckungsbeitragsschema
- Erweiterung der Sicherheitenkonfiguration
- Pflege von institutsindividuellen Parametern

Hinweise zur Produktkonfiguration

Tableaukonfiguration und Erstellung von Konditionentableaus (auch für OSPlus_neo)

- Verwendung von Laufvariablen
- Nutzungsmöglichkeiten und Pflege von Vorbelegungen
- Nutzung institutsindividueller Parameter
- Integration der Risikokostenberechnung bei Aktivprodukten

Darstellungsformen der Tableau-Ergebnisse

- Flexible Gestaltung der Ergebnisdarstellung
- Nutzergruppenspezifische (ggf. verkürzte) Darstellung vorhandener Ergebnisse

Berechnung und Freigabe der Tableau-Ergebnisse

Sonstige Tableaufunktionalitäten in MARZIPAN Web

- Nutzung von Kompaktansichten
- Tableauimport/-export
- Nutzung von Verlinkungen

Vorfälligkeitsberechnung mit MARZIPAN-KAPLAN (S593)

In diesem Seminar erhalten Sie einen Überblick über die rechtlichen Anforderungen hinsichtlich der Vorfälligkeitsentgeltberechnung und Sie lernen die Grundlagen der Bankkalkulation innerhalb der VFE-Berechnung kennen. Anhand von Rechenbeispielen aus der Praxis werden die Vorfälligkeitsentschädigungsberechnungen (VFE) vermittelt. Ergänzend werden die notwendigen Programmvoreinstellungen betrachtet, die Ihnen die Administration im eigenen Haus ermöglichen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Kalkulation/Kredit, die Vorfälligkeitsentschädigungsberechnungen mit MARZIPAN vornehmen

IHR NUTZEN

- Sie kennen im Überblick die rechtlichen Anforderungen der VFE.
- Sie können VFE-Berechnungen mit KAPLAN durchführen.
- Sie sind in der Lage, anhand der Programmvoreinstellungen die Administration in der eigenen Sparkasse vorzunehmen.

IHR REFERENT

Pascal Hintzen, msg for banking ag

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

450,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Rechtliche Grundlagen

Abgrenzung von Vorfälligkeitsentgelten und Aufhebungsentgelten

Bankfachlicher Hintergrund zur Berechnung

Parametrisierung der Voreinstellungen zur Risikokostenerstattung und des Institutsaufwands

Kalkulation der verschiedenen Arten von Geschäftsänderungen

- Vollablösungen
- Sondertilgungen
- Nicht- und Teilnichtabnahme

Fachlicher Hintergrund zur Margenerstattung

Parametrisierung von Margen- und Disagio-Erstattungen

Berechnung von vorzeitigen Prolongationen

- Ablösung des Altgeschäftes und Verzweigung ins "echte" Neugeschäft
- Betragsänderung
- Ratenaussetzung
- Änderung des Darlehentyps
- Berücksichtigung von vertraglich vereinbarten Sondertilgungsrechten

VFE-Berechnung bei Darlehen mit Disagio

Margenerstattung aus dem Neugeschäft

Verrechnung der Vorfälligkeitsentschädigung mit den Konditionen des Neugeschäfts

Vorstellung des Treppenrechners für Ablösungen mit unregelmäßigen Zahlungsströmen

Druck der verschiedenen Nachweise zur Angebotserstellung

Fachlicher Hintergrund der neuen MARZIPAN-KAPLAN-Funktionalitäten

- Optimierte Einbeziehung von Sondertilgungsrechten
- Optimierte Einbeziehung von Tilgungssatzwechsel- und Ratenwechselrechten

Vorstellung der Funktionalitäten anhand von Rechenbeispielen

Voreinstellungen zur optimierten Einbeziehung

Besonderheiten im Rahmen der Geschäftsdatenerfassung

Administration von MARZIPAN (S590)

In dieser Anwenderschulung werden die Administrationsfunktionen von MARZIPAN vorgestellt. Sie werden somit in die Lage versetzt, das Programm in der Sparkasse "in Betrieb" zu nehmen. Im Rahmen der Veranstaltung wird auch auf die Besonderheiten in der MARZIPAN-Administration für die Nutzung der Integrationsmöglichkeit in OSPlus_neo und OSPlus-Kredit eingegangen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Kalkulation sowie aus anderen Bereichen, in denen Kredite auf Einzelgeschäftsbasis kalkuliert werden sollen

IHR NUTZEN

- Sie kennen die Administrationsfunktionen von MARZIPAN.
- Sie können beispielsweise die Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata vornehmen.
- Sie sind in der Lage, die Anwendung in der Sparkasse "in Betrieb" zu nehmen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Fachliche Kenntnisse der Kalkulation mit MARZIPAN werden zwingend vorausgesetzt, da fachliche Grundlagen nicht Bestandteil dieser Veranstaltung sind. Diese werden im Seminar "Grundlagen der Kalkulation aktiv und passiv mit MARZIPAN (S592a)" (Angebotsnummer 30.370) vermittelt.

IHR REFERENT

Dr. Christoph Vogelsang, msg for banking ag

HINWEIS(E)

Die Konfiguration von Konditionen- bzw. Margentableaus mit MARZIPAN für OSPlus_neo ist nicht Bestandteil dieser Schulung. Bei Interesse an diesen Inhalten beachten Sie bitte unser Angebot "Tableaukonfiguration in MARZIPAN" mit der Angebotsnummer 30.381.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

2 Tage

PREIS

900,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Pflege der institutsübergreifenden Voreinstellungen

Marktdatenpflege

- Zinsstrukturkurven
- Bewertungszinsen
- Referenzzinsen

Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata

- Anlage von mehrstufigen Deckungsbeitragsschemata
- Integration von Ertrags-/Kostenpositionen
  - Ermittlung von Bonitätsprämien/Risikokosten/Optionskosten
  - Einbindung von Provisionen
  - Einbindung von individuellen Kostentableaus
- Pflege von Institutskriterien

Parametrisierung der Risikokostenberechnung

Einrichtung des Sicherheitensystems (Objektsicht)

Parametrisierung der Optionspreisermittlung

- Nutzung von Zinsvolatilitäten
- Hinterlegung von Ausübeverhalten/Ausübefunktionen

Entwicklung eines Berechtigungskonzeptes zur Benutzeradministration

Konfiguration von Produkten zur Nutzung in der Kundenberatung

- Aktivprodukte (exemplarisch)
  - Private Baufinanzierung
  - Gewerbliches Investitionsdarlehen
  - Konsumentenkredit
- Workflow zur fachlichen Abstimmung der Produktadministration
- Nutzergruppenspezifische Produktadministration

Exkurs: Integration von MARZIPAN in die OSPlus-Kreditprozesse und in OSPlus_neo

Neuerungen im OSPlus Release 25.0 zu Themenstellungen der Vor- und Nachkalkulation (online)

Standardlösung für die Konditionenermittlung in der Sparkasse ist die Softwarelösung MARZIPAN, welche über die Finanz Informatik (FI) zur Verfügung gestellt wird. Die Nachkalkulation (zoK) der FI verwendet im Hintergrund ebenfalls den MARZIPAN-Rechenkern. Im Rahmen der bewährten Release- und Weiterentwicklungsprozesse wird MARZIPAN stetig an veränderte technische, fachliche und prozessuale Anforderungen angepasst. Das Webinar gibt einen schnellen Überblick der Änderungen im aktuellen Release.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die die Anwendungen MARZIPAN und/oder zoK fachlich betreuen oder parametrisieren

IHR NUTZEN

- Sie sind in kompakter Form über die Neuerungen des OSPlus Releases 25.0 in der Vor- und Nachkalkulation informiert.
- Sie kennen die Neuerungen in der zoK (im Sinne einer Harmonisierung der Vor- und Nachkalkulation).

IHRE REFERENTIN

- Mitarbeiter/.innen der msg for banking ag

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Jahr 2025 in Abhängigkeit der relevanten Änderungen im Release 25.0 angeboten.

TERMIN(E)

2025

DAUER

1,5 Stunden

PREIS

wird noch mitgeteilt

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Wir werden die Inhalte mit einer separaten Akademieinformation veröffentlichen.

Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata (Teil 1) - Intensivierung und weitergehende Nutzungsmöglichkeiten (S598a) (online)

Zahlreiche Sparkassen verwenden zur Ermittlung ihrer Konditionen mit MARZIPAN das durch die Finanz Informatik vorinitialisierte Deckungsbeitragsschema. Die im Rahmen des Seminars "Administration von MARZIPAN" vermittelten Grundlagen zur Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata werden in diesem Webinar vertieft und es werden weitergehende Möglichkeiten der Nutzung von Deckungsbeitragsschemata vorgestellt.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für die Konfiguration der DB-Schemata verantwortlich sind und die bereits Kenntnisse in der Administration von MARZIPAN haben

IHR NUTZEN

- Sie kennen weitere Möglichkeiten zur Nutzung der DB-Schemata.
- Sie sind vertraut mit möglichen Rechenoperationen im Rahmen der Parametrisierung des Deckungsbeitragsschemas.
- Sie profitieren von Tipps für die Anwendung in der Sparkasse.

VORAUSSETZUNG(EN)

Fachliche Grundlagenkenntnisse der einzelnen Kostenkomponenten im Zuge der Nettomargenberechnung

IHRE REFERENTIN

Judith Schilling, msg for banking ag

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1,5 Stunden

PREIS

195,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Kurze Wiederholung wesentlicher Grundlagen

Nutzung der DB-Stufe 0

Nutzung nachgelagerter DB-Stufen

Einsatz von Operationen in der DB-Rechnung

Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata (Teil 2) - finanzmathematische Hintergründe (S598b) (online)

Zahlreiche Sparkassen verwenden zur Ermittlung ihrer Konditionen mit MARZIPAN das durch die Finanz Informatik vorinitialisierte Deckungsbeitragsschema. Die im Rahmen des Seminars "Administration von MARZIPAN" vermittelten Grundlagen zur Konfiguration von Deckungsbeitragsschemata werden in diesem Webinar vertieft und es werden weitergehende finanzmathematische Hintergründe vorgestellt.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für die Konfiguration der DB-Schemata verantwortlich sind und ihre Kenntnisse zu den mathematischen Hintergründen der Deckungsbeitragsrechnung vertiefen möchten

IHR NUTZEN

- Sie wissen, worin sich – auf den ersten Blick ähnliche – Kostentypen unterscheiden.
- Sie kennen die Konsequenzen der Margenentnahmemethodik auf die Deckungsbeitragsrechnungen.
- Sie sind damit vertraut, wie die Umrechnung zwischen den absoluten und prozentualen Werten erfolgt.

VORAUSSETZUNG(EN)

Grundlagenkenntnisse zur Effektivzinsrechnung und Deckungsbeitragskonfiguration

IHRE REFERENTIN

Judith Schilling, msg for banking ag

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1,5 Stunden

PREIS

195,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Kurze Wiederholung: Effektivzinsrechnung und Art der Berechnung der laufenden Marge

Abgrenzung der prozentualen Kostengrößen (Prozentsatz p. a.; Prozentsatz auf Restkapital (laufend); jährlicher Prozentsatz auf nominale Restschuld)

Umrechnung von absoluten und prozentualen Kosten im Deckungsbeitragsschema unter Berücksichtigung der Voreinstellungen zur Margenentnahme

Intensiv-Training für Einsteiger/-innen zur Vorkalkulation mit MARZIPAN

Dieses Intensiv-Training bietet neuen Mitarbeiterinnen und Mitarbeitern eine strukturierte Einarbeitung in die Aufgaben der Vorkalkulation und erleichtert damit einen erfolgreichen Start in die neue Tätigkeit. Im Rahmen von acht Onlinesessions werden wesentliche Basics der Vorkalkulation und die Zusammenhänge der einzelnen Preiskomponenten vermittelt. Anhand praxisnaher Beispiele werden die Teilnehmer/-innen an das Pricing mit der Software MARZIPAN herangeführt.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen im Bereich Kalkulation sowie aus anderen Bereichen, in denen Kredite auf Einzelgeschäftsbasis kalkuliert werden

Der Besuch dieses Intensiv-Trainings wird erfahrenen Mitarbeiterinnen und Mitarbeitern aus dem Bereich Kalkulation NICHT empfohlen.

IHR NUTZEN

- Sie sind mit den fachlichen sowie technischen Grundlagen vertraut und können Optimierungspotenziale identifizieren und umsetzen.
- Sie sind aufgrund der strukturierten Einarbeitung durch Kalkulations-Profis schneller in der Sparkasse produktiv und entlasten Einarbeitungskapazitäten in Ihrer Sparkasse.
- Sie können durch die Arbeit in Kleingruppen Ihre individuellen Fragen klären und eignen sich im Training Wissen in Ihrer hauseigenen Systemumgebung an.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Florian Murrmann, msg for banking ag

HINWEIS(E)

Im Rahmen dieses Intensiv-Trainings treffen sich maximal acht Teilnehmer/-innen wöchentlich über eine Laufzeit von acht Wochen zu einem zweistündigen Onlinetermin. Bitte buchen Sie stets alle Termine einer Serie.

In diesem Intensiv-Training werden die Basics der Kalkulation vermittelt, auch um die Teilnehmer/-innen auf den Besuch weiterführender Schulungen (z. B. Grundlagen der Kalkulation aktiv und passiv mit MARZIPAN [S592a] sowie Administration von MARZIPAN [S590]) vorzubereiten.

Dieses Intensiv-Training bieten wir mit unterschiedlichen Startterminen in Kooperation mit den Sparkassenakademien Baden-Württemberg, Bayern, Hessen-Thüringen und NOSA an. Bitte nehmen Sie Ihre Anmeldung im Buchungsportal der jeweils durchführenden Sparkassenakademie (oder per Mail bei den genannten Ansprechpartnern) vor. Folgende Starttermine sind derzeit geplant:

TERMIN(E)

02.11.2026 – 14.12.2026 |

Online-Seminar 1 (02.11.2026)
Online-Seminar 2 (05.11.2026)
Online-Seminar 3 (09.11.2026)
Online-Seminar 4 (16.11.2026)
Online-Seminar 5 (23.11.2026)
Online-Seminar 6 (30.11.2026)
Online-Seminar 7 (07.12.2026)
Online-Seminar 8 (14.12.2026)

03.06.2027 – 22.07.2027 |

Online-Seminar 1 (03.06.2027)
Online-Seminar 2 (10.06.2027)
Online-Seminar 3 (17.06.2027)
Online-Seminar 4 (24.06.2027)
Online-Seminar 5 (01.07.2027)
Online-Seminar 6 (08.07.2027)
Online-Seminar 7 (15.07.2027)
Online-Seminar 8 (22.07.2027)

DAUER

16 Stunden
8 Termine á 2 Stunden
09:00 - 11:00 Uhr

PREIS

1.420,00 € Gesamtpreis je Teilnehmer/-in (8 Termine)

- ab 2. November 2026: SKA NRW
- ab 2. Februar 2027: SGVHT (Anmeldung Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen)
- ab 6. April 2027: NOSA (Anmeldung Nord-Ostdeutsche Sparkassenakademie)
- ab 6. April 2027: SVB (Anmeldung Sparkassenakademie Bayern)
- ab 3. Juni 2027: SKA NRW
- ab 8. Juni 2027: SVBW (Anmeldung Sparkassenverband Baden-Württemberg)
- ab 4. November 2027: SVRP (Sparkassenverband Rheinland-Pfalz)

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Grundlagen der Begriffe und Fachlichkeit im Pricing

- Was versteht man unter Pricing und wo stehen die dazugehörigen aufsichtsrechtlichen Vorgaben?
- Welche Parameter beeinflussen die Preisbildung und woher kann das Institut diese beziehen?
- Was sagen die Parameter aus und wie sind die Wirkungsweisen im Pricing?

Grundlagen der Bankkalkulation innerhalb der Konditionenfindung

- Überblick (Leistungsumfang und Funktionsweise) der Software MARZIPAN
- Wie bildet sich die strukturkongruente Refinanzierung?
- Wie bildet sich der Effektivzins vs. Nominalzinssatz und welche Auswirkung hat eine inverse Zinskurve darauf?
- Wie und wo ermittelt man den Effektivzins nach PAngV und/oder ICMA?

Grundlagen der Deckungsbeitragsberechnung

- Welche Komponenten sollte das Deckungsbeitragsschema enthalten?
- Wie kalkuliert das Deckungsbeitragsschema in MARZIPAN und welche Abhängigkeiten bestehen?

Produkt-Markt-Matrix

- Welche Produkte gibt es im Aktivgeschäft und was sind die jeweiligen Spezifika?
- Was muss bei unterschiedlichen Produkten in der Zuordnung von Parametern im Pricing berücksichtigt werden?

Erste Schritte der Administration

- Welche Software steht zur Administration von MARZIPAN zur Verfügung?
- Wie kann ich ein erstes einfaches Produkt administrieren?

30 BANKSTEUERUNG

Reporting/Prognose/IDH

Management Reporting (IDH-Reporting) - Grundlagen (S695a) - (online)

In dieser Grundlagenschulung lernen Sie die Oberfläche in der Kachel Management Reporting (IDH-Reporting) kennen und werden mit den grundlegenden Funktionen der Standardberichte IDH vertraut. Einstellungen an Standardberichtsschablonen, die Erstellung von flüchtigen und statischen Berichten sowie die Anlage von Fächern und deren Bereitstellung für weitere Adressaten sind u. a. Inhalte des Webinars.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Gesamtbanksteuerung, die mit der Kachel Management Reporting im IDH-Reporting arbeiten (Reportabrufende, Reportbearbeitende, Reportfreigebende) sowie Multiplikatorinnen und Multiplikatoren für die Pflege der Anwendung

IHR NUTZEN

- Sie können sich im IDH-Reporting, insbesondere in der Kachel Management Reporting, orientieren und wissen, welche KURS-Rechte Nutzer/-innen benötigen.
- Sie kennen den Unterschied zwischen Berichtsschablonen und Berichtsinstanzen.
- Sie sind in der Lage, Berichtsschablonen zu öffnen, Grundeinstellungen zu administrieren und zum gewünschten Stichtag Berichte zu erstellen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Die Kachel Management Reporting mit den Berichten aus dem Ordner „Standardberichte IDH“ ist bei Ihrem Institut in der Nutzung. Sie benötigen für das Seminar einen S-User mit nachfolgenden KURS-Rechten: IDH-ABRUF, IDH-BEARBEIT, IDH-FREIGEB und ggf. IDH-DESIGN (jeweils ohne Feindefinitionen).

Um im Seminar Instanzen aus Berichtsschablonen erstellen zu können, ist es notwendig, dass Sie in den RTF-Berichten 3.1 (Ökonomisches Risikodeckungspotential) und 3.2 (Risikoarten und Limitierung) Daten zu mindestens zwei aufeinanderfolgenden Quartalsstichtagen abrufen können. Bitte erstellen Sie hierzu entsprechende Simulationen in RTF und geben diese zur Überleitung in das Management Reporting frei.

Bei abgeschlossener Integration der Anwendung in das OSP BI findet die Veranstaltung unter Berücksichtigung der neuen Umgebung statt.

IHRE REFERENTIN

Christiana Uhlenbruch, CP Consultingpartner AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung findet als Webinar statt. Damit Sie die Tätigkeiten, die am Bildschirm präsentiert werden, direkt am eigenen System nachvollziehen können, empfehlen wir die Nutzung eines zweiten Bildschirms.

TERMIN(E)

06.07.2027 | virtueller Seminarraum
09:00 – 11:00 Uhr

DAUER

2 Stunden

PREIS

210,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einstieg IDH-Reporting

Berichte erstellen

Fächer anlegen

Berichtsschablonen/Berichte hinzufügen und anderen Nutzern zur Verfügung stellen

Anpassung von Schwellen an Berichtskennzahlen

Management Reporting (IDH-Reporting) - Aufbauveranstaltung - Erstellung von individuellen Berichten auf Basis von Standardberichtsschablonen (S695b) - (online)

In dieser Aufbauschulung lernen Sie alle notwendigen Schritte für die Erstellung individueller Berichtsschablonen auf Basis von Standardberichtsschablonen aus dem Ordner "Standardberichte IDH". Sie erhalten einen grundlegenden Einblick in die Administration von IDHR-Berichten, um eigene individuelle Berichtsschablonen zu erstellen: von den Berichtseinstellungen über die Zusammenstellung einer adäquaten Datengrundlage bis zum Datenausweis in unterschiedlichen Arten von Berichtselementen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Gesamtbanksteuerung, die mit der Kachel Management Reporting im IDH-Reporting arbeiten (Reportabrufende, Reportbearbeitende, Reportfreigebende) sowie Multiplikatorinnen und Multiplikatoren für die Pflege der Anwendung

IHR NUTZEN

- Sie wissen, welche Möglichkeiten es gibt, Standardberichtsschablonen zu individualisieren.
- Sie sind in der Lage, eine Datengrundlage und darauf basierend statische und dynamische Tabellen sowie Diagramme zu erstellen.
- Sie können individuelle Filter in Berichtsschablonen einfügen und haben einen Einblick, wie einfache Berechnungen mit Berichtskennzahlen konfiguriert werden können.

VORAUSSETZUNG(EN)

Technische Voraussetzungen:

Die Kachel Management Reporting mit den Berichten aus dem Ordner "Standardberichte IDH" ist bei Ihrer Sparkasse in der Nutzung.

Sie benötigen für das Seminar einen S-User mit nachfolgenden KURS-Rechten: IDH-ABRUF, IDH-BEARBEIT, IDH-FREIGEB und ggf. IDH-DESIGN (jeweils ohne Feindefinitionen).

Um im Seminar eigene Berichtsschablonen erstellen zu können, ist es notwendig, dass Sie in den RTF-Berichten 3.1 (Ökonomisches Risikodeckungspotential) und 3.2 (Risikoarten und Limitierung) Daten zu mindestens zwei aufeinanderfolgenden Quartalsstichtagen abrufen können. Bitte erstellen Sie hierzu entsprechende Simulationen in RTF und geben diese zur Überleitung in das Management Reporting frei.

Fachliche Voraussetzungen:

Besuch der Grundlagenschulung (S695a) oder sichere Praxiserfahrungen bei der Nutzung der Kachel Management Reporting (z. B. Öffnen von Berichtsschablonen, Einstellungen an Standardschablonen, Erstellung von Berichten und Fächern)

TERMIN(E)

27.09.2027 | virtueller Seminarraum
09:00 – 13:00 Uhr

DAUER

4 Stunden

PREIS

320,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

IHRE REFERENTIN

Christiana Uhlenbruch, CP Consultingpartner AG

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung findet als Online-Seminar statt. Damit Sie die Tätigkeiten, die am Bildschirm präsentiert werden, direkt am eigenen System nachvollziehen können, empfehlen wir die Nutzung eines zweiten Bildschirms.

Diese Veranstaltung widmet sich der Administration von Berichten im IDH-Reporting. Fachliche Fragen zu den Berichten der neuen Banksteuerung sind nicht Bestandteil des Webinars.

Bei abgeschlossener Integration der Anwendung in das OSP BI findet die Veranstaltung unter Berücksichtigung der neuen Umgebung statt.

Programm/Inhalt

Individualisierung bzw. Erstellung von Berichtsschablonen aus dem Ordner "Standardberichte IDH"

Administration der Grundeinstellungen von Berichtsschablonen

Bearbeitung/Neuanlage von Datengrundlagen

Bearbeitung/Neuerstellung diverser Berichtselemente (vor allem Box, Tabelle, Diagramme)

Berechnungen mit Berichtskennzahlen

Einfügen von Filtern

Hinweise zur Formatierung von Tabellen und Diagrammen

Management Reporting (IDH-Reporting) - Expertenworkshop (S695c) - (online)

Zur Vertiefung Ihrer Kenntnisse in der Administration von individuellen Berichtsschablonen bieten wir Ihnen diesen Expertenworkshop in komprimierter Form an. Im Fokus stehen Empfehlungen zur praktischen Umsetzung von sparkassenindividuellen Fragestellungen. Mit der Übermittlung Ihrer Fragen nehmen Sie auf die inhaltliche Gestaltung des Webinars Einfluss.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Gesamtbanksteuerung, die mit der Kachel Management Reporting im IDH-Reporting arbeiten (Reportabrufende, Reportbearbeitende, Reportfreigebende) sowie Multiplikatorinnen und Multiplikatoren für die Pflege der Anwendung

IHR NUTZEN

- Sie kennen Antworten auf konkrete Fragestellungen bei der Einstellung von Standardberichtsschablonen sowie der Administration von individuellen Berichtsschablonen.
- Sie sind mit Lösungen für Problemstellungen bei der Berichtsadministration vertraut.

VORAUSSETZUNG(EN)

siehe Hinweise

IHR REFERENT

siehe Hinweise

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung bieten wir in Kooperation mit der Sparkassenakademie Niedersachsen an. Sie wird in Hannover durchgeführt. Für weitere Informationen (z. B. Inhalte, Termin/e sowie Preis) und zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen:

Hier klicken

Wenn Sie sich bisher noch nicht für das Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen registriert haben, so können Sie formlos über die E-Mail-Adresse akademiemail@svn.de oder telefonisch (Tel.: 0511 3603 501) einen Zugang beantragen.
Webcode in Niedersachsen: WB3207

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

2 Stunden

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

siehe Hinweise

Umsteiger-Seminar für IDH-Anwender auf OSPlus BI (online)

Aktuell läuft der Rollout der IDH-Auswertungen für das OSPlus BI. Die bisherige IDH-Anwendung wird voraussichtlich bis Ende 2027 parallel angeboten. Mit dem Abschluss der Rollout-Serie Ende Juli 2026 sollen allen Sparkassen die neuen Auswertungen für das IDH auch im OSPlus BI zur Verfügung stehen. Dieses Umsteiger-Seminar gibt Ihnen einen Überblick zur Nutzung der Anwendung OSPlus BI für IDH-Auswertungen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die aktuell oder zukünftig Abfrageschablonen im IDH nutzen

IHR NUTZEN

- Sie wissen, wie Sie die Standardauswertungen in der Anwendung OSPlus BI nutzen können.
- Sie sind in der Lage, individuelle IDH-Auswertungen in das OSPlus BI zu migrieren.
- Sie haben durch praktische Übungen in den eigenen Institutsdaten ein vertieftes Wissen über die Nutzung der Anwendung OSPlus BI für IDH-Auswertungen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Für die Teilnahme an diesem Webinar benötigen Sie folgende Rechte: im alten IDH (IDH-R) das IDH-BEARBEIT-KURS-Recht für den Fachbereich ZOK. Zusätzlich benötigen Sie im OSPBI das OSPBI-BEARBEIT-Kursrecht für den Fachbereich ZOK und das OSPBI-SONDER-Recht mit den Feindefinitionen MIGRATION und SQL.

Bitte testen Sie im Vorfeld der Veranstaltung, ob Sie die IDH-Abfragen im OSPlus-BI finden und abrufen können. Diese Veranstaltung findet im Echtsystem Ihrer Sparkasse statt. Bitte gewährleisten Sie den Zugriff auf Ihre Sparkassenumgebung.

Tätigkeiten, die am Bildschirm präsentiert werden, können während des Seminars direkt im eigenen System nachvollzogen werden. Dafür ist es erforderlich, dass bei der Teilnahme am Online-Seminar entweder
a) am PC ein zweiter Bildschirm existiert oder
b) die Präsentation über ein zweites Gerät (z. B. ein iPad) verfolgt wird.

IHR REFERENT

Christian Rösch, CP Consultingpartner AG

HINWEIS(E)

Aktuell liegen Einschränkungen bei der Nutzung des IDH Reporting im OSPlus BI vor. Details können Sie der im Akademieportal in der Veranstaltungsbeschreibung unter DOKUMENTE & LINKS abrufbaren PDF-Datei entnehmen. Außerdem gibt es zum aktuellen Zeitpunkt keine feste Zusage, dass bis Mitte September weitere Fachgebiete aus dem IDH (insbesondere das Meldewesen) freigeschaltet sind. Die Bedienung der Abfragen und die Logik für den Bereich Meldewesen unterscheidet sich jedoch nicht von den anderen Abfragebereichen. Wir gehen deshalb von einem positiven Lerneffekt auch für

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

525,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Meldewesen durch den Besuch des Seminars auf Basis des aktuellen Umsetzungstandes aus.

Programm/Inhalt

Aufruf der Anwendung und Funktionsüberblick

Gegenüberstellung zur alten IDH-Anwendung

Nutzung von IDH-Abfrageschablonen im OSPlus BI (ohne SQL)

Migration von IDH-Abfrageschablonen in das OSPlus BI

Nutzung von Parametern und Textbausteinen im OSPlus BI

Berechtigungen im OSPlus BI

30 BANKSTEUERUNG

Marktpreisrisikosteuerung

MPR-Videoaufzeichnungen

Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Grundlagen (online) (S671)

Die Finanz Informatik setzt die Software SimCorp Dimension (SCD) im Rahmen der Gesamtbanklösung One System Plus (OSPlus) ein. SCD bildet dabei den gesamten Geschäftsprozess ab, den ein Handelsgeschäft innerhalb eines Institutes unter Berücksichtigung der komplexen gesetzlichen Anforderungen im Eigenhandel durchläuft. In diesem Seminar lernen Sie die Grundlagen im Umgang mit der Anwendung kennen.

ZIELGRUPPE

Das Seminar richtet sich an Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Handel, Abwicklung, Controlling, Revision und Meldewesen, die mit Arbeiten rund um das Thema Eigenhandelsgeschäfte gemäß MaRisk befasst sind

IHR NUTZEN

- Sie sind vertraut mit dem Aufbau der Anwendung SimCorp Dimension.
- Sie kennen die relevanten Workflows im System.
- Sie sind in der Lage, mögliche individuelle Problemstellungen zu lösen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Erfahrungen mit der Anwendung SimCorp Dimension sind von Vorteil, aber nicht zwingend notwendig.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Torben Weirich, Finanz Informatik GmbH & Co. KG
- Marvin Hartshorne, Finanz Informatik GmbH & Co. KG
- Daniel Waßmuth, Finanz Informatik GmbH & Co. KG

HINWEIS(E)

Das Seminar ist speziell für SCD-Neueinsteiger konzipiert und vermittelt das für alle Bereiche notwendige SCD-Basiswissen, das notwendig ist, um mit dem System sicher arbeiten zu können.

Die SCD-Schulungsumgebung ist ausschließlich über die Arbeitsplatzumgebung aufrufbar. Sie benötigen somit eine SEVA-Verbindung, wenn Sie das Onlineseminar im Homeoffice absolvieren. Die Nutzung von zwei Bildschirmen (einer für die Arbeit in der Umgebung, einer zum Folgen der Präsentation) wird empfohlen.

TERMIN(E)

20.09.2027 | virtueller Seminarraum

DAUER

1 Tag

PREIS

455,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Aufbau der Anwendung SimCorp Dimension

Geschäftsstatuskonzept (MaRisk-Workflow)

Geschäfte anzeigen, Echtbestand, Limite

Relevante Einstellungen in SimCorp Dimension

Gattungsdaten, Stichtags-/Periodenberechnung

Relevante Berichte und Auswertungen

Übungen

Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Handel (online) (S672)

SimCorp Dimension ist eine integrierte, mandantenfähige und MaRisk-konforme Anwendung für das Handelsgeschäft der Sparkassen. Basis für den durchgängigen MaRisk-Workflow ist ein elektronischer Händlerzettel, der es ermöglicht, den gesamten MaRisk-Arbeitsprozess papierlos im System abzubilden. Für den Handel stehen standardisierte Übersichten über die Depot-A-Bestände online zur Verfügung. Neben aktuellen Marktbewertungen mit Bewertungsmodellen und verschiedenen Kennzahlen sind die Gewinn-Verlust-Sicht und die market-to-market-Risikosicht (Value-at-risk) enthalten. Simulationen und Überwachungen von Adressausfallrisiken und Verlustobergrenzen sind integriert. In diesem Seminar lernen Sie die Möglichkeiten des Handelns mit SimCorp Dimension kennen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Handel, die in den MaRisk-Prozess im Rahmen von Handelsgeschäften eingebunden sind sowie optional aus dem Bereich Revision

IHR NUTZEN

- Sie sind vertraut mit dem MaRisk-Workflow für Handelsgeschäfte und der Abbildung des Echtbestands in der Anwendung SimCorp Dimension.
- Sie sind in der Lage, Gattungsdaten anzulegen und Geschäfte in SimCorp Dimension einzugeben.
- Sie können Handelsgeschäfte simulieren und Limitauslastungen überprüfen.

VORAUSSETZUNG(EN)

- Seminar: Risikomanagement mit SimCorp Dimension (30.585) oder vergleichbarer Kenntnisstand
- Betriebswirtschaftliche Kenntnisse im Bereich MaRisk

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Marvin Hartshorne, Finanz Informatik GmbH & Co. KG
- Daniel Waßmuth, Finanz Informatik GmbH & Co. KG
- Torben Weirich, Finanz Informatik GmbH & Co. KG

HINWEIS(E)

Die SCD-Schulungsumgebung ist ausschließlich über die Arbeitsplatzumgebung aufrufbar. Sie benötigen somit eine SEVA-Verbindung, wenn Sie das Onlineseminar im Homeoffice absolvieren. Die Nutzung von zwei Bildschirmen (einer für die Arbeit in der Umgebung, einer zum Folgen der Präsentation) wird empfohlen.

TERMIN(E)

21.09.2027 | virtueller Seminarraum

DAUER

1 Tag

PREIS

455,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Geschäftsstatuskonzept (MaRisk-Workflow)

Gattungsdatenanlage anhand von Beispielen

Erstellung von Vorlagen

Eingabe von Geschäften (Aktien, Renten, Optionen, Futures, Zinsswaps, Geldmarkt- und Devisengeschäfte, WP-Repo/WP-Leihe)

Echtbestand

Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Abwicklung (online) (S673)

SimCorp Dimension ist eine integrierte, mandantenfähige und MaRisk-konforme Anwendung für das Handelsgeschäft der Sparkassen. Basis für den durchgängigen MaRisk-Workflow ist ein elektronischer Händlerzettel, der es ermöglicht, den gesamten MaRisk-Arbeitsprozess papierlos im System abzubilden. Die Abwicklung nutzt die hochgradige Automatisierung der administrativen Geschäftsvorfälle. Die regelbasierte Marktgerechtigkeitsprüfung reduziert manuelle Tätigkeiten des Anwenders auf die Bearbeitung der systemseitig angezeigten Abweichungen. Zusätzlich können alle Geschäftsvorfälle über fein abgestufte Selektionsbedingungen abgefragt werden. In diesem Seminar lernen Sie die Möglichkeiten der Abwicklung mit SimCorp Dimension kennen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich Abwicklung, die in den MaRisk-Prozess eingebunden sind sowie optional aus dem Bereich Revision

IHR NUTZEN

- Sie sind vertraut mit dem Workflow im Sinne der MaRisk im Rahmen von Handelsgeschäften und der Abbildung des Echtbestands in der Anwendung SimCorp Dimension.
- Sie können Handels- und Backofficegeschäfte abwickeln.
- Sie können Gattungsdaten anlegen sowie die Handelskontrolle durchführen.

VORAUSSETZUNG(EN)

- Seminar: Risikomanagement mit SimCorp Dimension (30.585) oder vergleichbarer Kenntnisstand
- Betriebswirtschaftliche Kenntnisse im Bereich MaRisk

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Marvin Hartshorne, Finanz Informatik GmbH & Co. KG
- Daniel Waßmuth, Finanz Informatik GmbH & Co. KG
- Torben Weirich, Finanz Informatik GmbH & Co. KG

HINWEIS(E)

Die SCD-Schulungsumgebung ist ausschließlich über die Arbeitsplatzumgebung aufrufbar. Sie benötigen somit eine SEVA-Verbindung, wenn Sie das Onlineseminar im Homeoffice absolvieren. Die Nutzung von zwei Bildschirmen (einer für die Arbeit in der Umgebung, einer zum Folgen der Präsentation) wird empfohlen.

TERMIN(E)

22.09.2027 | virtueller Seminarraum

DAUER

1 Tag

PREIS

455,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

MaRisk-Workflow

Geschäfte anzeigen

Echtbestand

Backoffice-Geschäfte

Umbuchungen

Transaktionsmeldewesen

Der Jahresabschluss mit SimCorp Dimension (S696)

Welche Anforderungen sind bei der Durchführung des Jahresabschlusses mit SimCorp Dimension zu beachten? Wie kann der Jahresabschluss mit SimCorp Dimension optimal vorbereitet werden? Antworten auf diese und weitere Fragen erhalten Sie in diesem Seminar.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen in der Abwicklung/im Rechnungswesen, die den Jahresabschluss in SimCorp Dimension erstellen

IHR NUTZEN

- Sie können den Jahresabschluss und den steuerlichen Jahresabschluss in SimCorp Dimension umsetzen.
- Sie kennen die notwendigen Aktivitäten zwischen dem Jahresende und dem Jahresabschluss.
- Sie erhalten weiterführende Informationen zu den Vorbereitungen für den Jahresabschluss mit SimCorp Dimension.

VORAUSSETZUNG(EN)

- Seminar: Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Abwicklung (Angebotsnummer 30.587) oder vergleichbarer Kenntnisstand
- Betriebswirtschaftliche Kenntnisse im Bereich MaRisk

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

siehe Hinweise

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung bieten wir in Kooperation mit der Sparkassenakademie Niedersachsen an.
Sie wird in Hannover durchgeführt. Für weitere Informationen (z. B. Inhalte, Termin/e sowie
Preis) und zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen: Hier klicken
Wenn Sie sich bisher noch nicht für das Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen registriert haben, so können Sie formlos über die E-Mail-Adresse akademiemail@svn.de oder telefonisch (Tel.: 0511 3603 501) einen Zugang beantragen.
Webcode in Niedersachsen: SM3110

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

siehe Hinweise

Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Anlieferung an das Meldewesen - Aufbauseminar (S689) (online)

In diesem Seminar lernen Sie die zentralen Felder und Funktionen der Anwendung SimCorp Dimension (SCD) kennen, die zur Erfüllung der nationalen aufsichtsrechtlichen Meldepflichten notwendig sind. Anhand von praktischen Beispielen werden die notwendigen Schritte in SCD vermittelt, sodass Sie nach dem Seminar in der Lage sind, eigenständig die Datenpflege und Analyse in SCD vorzunehmen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Handel, Abwicklung, Controlling und Meldewesen, die regelmäßig Eingaben und/oder Abfragen in SimCorp Dimension vornehmen

IHR NUTZEN

- Sie sind mit den zentralen Feldern und Funktionen der Anwendung SCD vertraut, die zur Erfüllung der nationalen aufsichtsrechtlichen Meldepflichten notwendig sind.
- Sie kennen die Kennzeichnungsmöglichkeiten in SCD für die Meldeanforderungen gemäß Basel III (Corep), LCR, ALMM, FinRep, AWV sowie optional für die Fondsdurchschau nach der Transparenzmethode.
- Sie sind in der Lage sind, eigenständig die Datenpflege und Analyse in SCD vorzunehmen.

HINWEIS(E)

Bitte beachten Sie, dass die Erfassungsmöglichkeiten zur Erfüllung der Transaktionsregistermeldungen (EMIR Refit, MiFIR und SFTR) in diesem Seminar nicht behandelt werden. Ebenso ist die Anwendung BAIS nicht Bestandteil dieses Seminars, es geht ausschließlich um die Tätigkeiten in SCD.

Die Veranstaltung bieten wir in Kooperation mit der Sparkassenakademie Niedersachsen an. Die Veranstaltung findet in den virtuellen Seminarräumen der Sparkassenakademie Niedersachsen statt. Ihre Zugangsdaten und weitere technische Infos erhalten Sie mit der Einladung zum Online-Seminar. Für weitere Informationen (z. B. Inhalte, Termin/e sowie Preis) und zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen: Hier klicken

Wenn Sie sich bisher noch nicht für das Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen registriert haben, so können Sie formlos über die E-Mail-Adresse akademiemail@svn.de oder telefonisch (Tel.: 0511 3603 501) einen Zugang beantragen.

Webcode in Niedersachsen: SM3116

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

0,5 Tage

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

siehe Hinweise

Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Transaktionsmeldewesen in SCD zu EMIR Refit (S676a) (online)

In dieser Veranstaltung steht die Vermittlung des Wissens zur Transaktionsregistermeldung "EMIR Refit" aus SCD im Fokus. Nach dem Besuch des Seminars können Sie eigenständig Meldungen aus SCD absetzen, die Rückmeldungen des Transaktionsregisters bewerten und entsprechend reagieren. Anhand von zahlreichen Beispielen aus der Praxis werden Ihnen gängige Aufgaben aus der täglichen Arbeit präsentiert (Datenpflege, Fehleranalysen, Korrekturen).

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich "Abwicklung", die für Abwicklung und Kontrolle von Handelsgeschäften verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie sind mit dem relevanten Wissen zur Transaktionsregistermeldung "EMIR Refit" aus SCD vertraut.
- Sie sind in der Lage, eigenständig Meldungen aus SCD abzusetzen, die Rückmeldungen des Transaktionsregisters zu bewerten und entsprechend zu reagieren.
- Sie können den zugehörigen PPS-Prozess einsetzen.

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung bieten wir in Kooperation mit der Sparkassenakademie Niedersachsen an. Die Veranstaltung findet in den virtuellen Seminarräumen der Sparkassenakademie Niedersachsen statt. Ihre Zugangsdaten und weitere technische Infos erhalten Sie mit der Einladung zum Online-Seminar. Für weitere Informationen (z. B. Inhalte, Termin/e sowie Preis) und zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen: Hier klicken

Wenn Sie sich bisher noch nicht für das Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen registriert haben, so können Sie formlos über die E-Mail-Adresse akademiemail@svn.de oder telefonisch (Tel.: 0511 3603 501) einen Zugang beantragen.

Webcode in Niedersachsen: SM3365

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

0,3 Tage

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

siehe Hinweise

Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Transaktionsmeldewesen in SCD zu MiFIR Art. 26 (S676b) (online)

In dieser Veranstaltung steht die Vermittlung des Wissens zur Transaktionsregistermeldung nach Art. 26 "MiFIR" aus SCD im Fokus. Nach dem Seminar können Sie eigenständig Meldungen aus SCD absetzen, die Rückmeldungen des Transaktionsregisters bewerten und entsprechend reagieren. Anhand von zahlreichen Beispielen aus der Praxis werden Ihnen gängige Aufgaben aus der täglichen Arbeit präsentiert (Datenpflege, Fehleranalysen, Korrekturen).

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich "Abwicklung", die für Abwicklung und Kontrolle von Handelsgeschäften verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie sind mit dem relevanten Wissen zur Transaktionsregistermeldung nach Art. 26 "MiFIR" aus SCD vertraut.
- Sie sind in der Lage, eigenständig Meldungen aus SCD abzusetzen, die Rückmeldungen des Transaktionsregisters zu bewerten und entsprechend zu reagieren.
- Sie können den zugehörigen PPS-Prozess einsetzen.

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung bieten wir in Kooperation mit der Sparkassenakademie Niedersachsen an. Die Veranstaltung findet in den virtuellen Seminarräumen der Sparkassenakademie Niedersachsen statt. Ihre Zugangsdaten und weitere technische Infos erhalten Sie mit der Einladung zum Online-Seminar. Für weitere Informationen (z. B. Inhalte, Termin/e sowie Preis) und zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen: Hier klicken

Wenn Sie sich bisher noch nicht für das Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen registriert haben, so können Sie formlos über die E-Mail-Adresse akademiemail@svn.de oder telefonisch (Tel.: 0511 3603 501) einen Zugang beantragen.

Webcode in Niedersachsen: SM3366

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

0,3 Tage

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

siehe Hinweise

Risikomanagement mit SimCorp Dimension (SCD) - Transaktionsmeldewesen in SCD zu SFTR (S676c) (online)

In dieser Veranstaltung steht die Vermittlung des Wissens zur Transaktionsregistermeldung "SFTR" aus SCD im Fokus. Nach dem Seminar können Sie eigenständig Meldungen aus SCD absetzen, die Rückmeldungen des Transaktionsregisters bewerten und entsprechend reagieren. Anhand von zahlreichen Beispielen aus der Praxis werden Ihnen gängige Aufgaben aus der täglichen Arbeit präsentiert (Datenpflege, Fehleranalysen, Korrekturen).

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus dem Bereich "Abwicklung", die für Abwicklung und Kontrolle von Handelsgeschäften verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie sind mit dem relevanten Wissen zur Transaktionsregistermeldung "SFTR" aus SCD vertraut.
- Sie sind in der Lage, eigenständig Meldungen aus SCD abzusetzen, die Rückmeldungen des Transaktionsregisters zu bewerten und entsprechend zu reagieren.
- Sie können den zugehörigen PPS-Prozess einsetzen.

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung bieten wir in Kooperation mit der Sparkassenakademie Niedersachsen an. Die Veranstaltung findet in den virtuellen Seminarräumen der Sparkassenakademie Niedersachsen statt. Ihre Zugangsdaten und weitere technische Infos erhalten Sie mit der Einladung zum Online-Seminar. Für weitere Informationen (z. B. Inhalte, Termin/e sowie Preis) und zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen: Hier klicken

Wenn Sie sich bisher noch nicht für das Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen registriert haben, so können Sie formlos über die E-Mail-Adresse akademiemail@svn.de oder telefonisch (Tel.: 0511 3603 501) einen Zugang beantragen.

Webcode in Niedersachsen: SM3367

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

0,3 Tage

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

siehe Hinweise

Umsetzung des Investmentsteuergesetzes (InvStG) 2018 in SimCorp Dimension (SCD)

Die neuen Funktionalitäten in SimCorp Dimension (SCD) ermöglichen die Berechnung der steuerlichen Bewertungs- und Veräußerungsergebnisse, welche bisher anhand des „Excel- Tools zur Ermittlung von Bewertungs- und Veräußerungsergebnissen“ bestimmt wurden. Lernen Sie, wie Sie das Investmentsteuergesetz (InvStG) mit den neuen Funktionalitäten in SimCorp Dimension (SCD) umsetzen können. Ziel ist es, das bisherige "Excel-Tool zur Ermittlung von Bewertungs- und Veräußerungsergebnissen" in SCD implementieren zu können.

ZIELGRUPPE

Steuerfachlich Verantwortliche im Rechnungswesen, die sich mit der steuerlichen Behandlung von Investmentfonds befassen und für die fachliche Aufbereitung der Fondsdaten sowie deren Integration in das System zuständig sind

Zusätzliche Teilnahme der berechtigten SCD-Anwender/-innen (i. d. R. werden Abwickler-Rechte benötigt), die die entsprechenden Erfassungen und Eingaben vornehmen werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die neuen Funktionalitäten in SCD und können diese anwenden.
- Sie haben einen Überblick, welche SCD-Berichte künftig zur Verfügung stehen.
- Sie wissen, welche Auswirkungen sich auf die SCD-Automatik-Buchungen ergeben.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Das Seminar wird in Zusammenarbeit mit der Finanz Informatik und den steuerfachlich Verantwortlichen des RSGV sowie des SVWL durchgeführt.

Dabei wird der Termin am 28.09.2026 von Paulina Ehrhardt (RSGV) und der Termin am 02.10.2026 von Martin Beckmann (SVWL) begleitet.

HINWEIS(E)

Das Seminar dient der Umsetzung der Organisationsrundschreiben der Finanz Informatik Nr. 1186 vom 16. Mai 2023 und Nr. 1376 vom 27. September 2023.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

375,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Jana Bathe
0231 22240-709
jana.bathe@ska.nrw

INHALTE



Sabine Berens
0231 22240-740
sabine.berens@ska.nrw

Programm/Inhalt

Überblick über die neuen SCD-Funktionalitäten zur Berechnung der steuerlichen Bewertungs- und Veräußerungsergebnisse

Vorbereitungsmaßnahmen für die korrekte Ermittlung der Ergebnisse über SCD

Erfassungsmöglichkeiten in SCD

SCD-Berichte

Auswirkungen auf SCD-Automatik-Buchungen

30 BANKSTEUERUNG

Zinsbuchsteuerung/GuV-Planung

Grundlagenschulung zur Zinsbuchsteuerung (online)

Sie möchten Grundlagenwissen im Bereich Zinsbuchsteuerung aufbauen und in der Sparkasse aktiv mit der caballito-App "Zinsbuch-Reporting" arbeiten? In dieser Veranstaltung werden die Grundlagen der Zinsbuchsteuerung auf Basis der Konzepte der SR vermittelt. Neben den fachlichen Inhalten wird auch auf die technische Umsetzung eingegangen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Controlling, Handel/Treasury und Revision

IHR NUTZEN

- Sie sind mit den Grundlagen der Zinsbuchsteuerung vertraut.
- Sie kennen die Prozessschritte zur Zinsbuchsteuerung.
- Sie können die caballito-App "Zinsbuch-Reporting" in der Sparkassenpraxis anwenden.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Vivian Dauer, Ostdeutscher Sparkassenverband
Carolin Schneider, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Niedersachsen, der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie und der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten. Sparkassen aus Nordrhein-Westfalen melden ihre Teilnehmer/-innen bitte bei der Sparkassenakademie Nordrhein-Westfalen an.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Grundlagen der Zinsbuchsteuerung auf Basis der Konzepte der SR

- Managementstrategien
- Zinsbuch für die interne Steuerung
- Begriffsdefinition, Benchmarks und Maßnahmen

Prozessschritte zur Zinsbuchsteuerung

Umsetzung der barwertigen Zinsbuchsteuerung

Caballito-App "Zinsbuch-Reporting"

Sparkassenakademie
Nordrhein-Westfalen

30 BANKSTEUERUNG

Liquiditätsmanagement

LQR-Videoaufzeichnungen

Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - Plan-Liquiditätsablaufbilanz (Plan-LAB) (online)

In dieser Veranstaltung erhalten Sie detaillierte Einblicke in den fachlichen und technischen Umsetzungsstand zum Thema Plan-Liquiditätsablaufbilanz. Betrachtet werden die fachlichen Inhalte zur Methodik sowie die Umsetzung der regulatorischen Anforderungen in der Anwendung. Es erfolgt eine praxisnahe Vermittlung des Moduls Plan-LAB und eine Einordnung in die Banksteuerungsarchitektur des IDH.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Risikocontrolling oder in der Banksteuerung (insbesondere für die Anwendung Plan-LAB) ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen Grundlagen und Hintergründe der Methodik des LQR-Moduls Plan-LAB.
- Sie sind in der Lage, die Anwendung in der Sparkassenpraxis zu bedienen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Betriebswirtschaftliche Grundkenntnisse

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Jörg Rausmann, Sparkassenverband Westfalen-Lippe
- Melanie Schmacht, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
- Philipp Sturm, Sparkassen Rating und Risikosysteme GmbH

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten. Ihre Anmeldungen erfolgen über die Sparkassenakademie Nordrhein-Westfalen.

TERMIN(E)

12.11.2026 | virtueller Seminarraum
10:00 – 12:00 Uhr

DAUER

2 Stunden

PREIS

175,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Einordnung von LQR in die Anwendungslandschaft des IDH im Rahmen der Gesamtbanksteuerung

Plan-LAB: das Modell und der Praxiseinsatz

- Virtuelle Kasse aus GBS
- Vorgehen Plan-LAB virtuelle Kasse GBS
- Anwendungsanleitung
- Interpretation und Plausibilisierung der Ergebnisse

Abschlussdiskussion

Methodische Grundlagen zum Liquiditätskostenverrechnungssystem (LVS) (online)

In diesem Onlineseminar erhalten Sie ein fundiertes, praxisnahes Verständnis des Liquiditätskostenverrechnungssystems. Dabei werden die methodischen Grundlagen zum Prozess der Liquiditätskostenverrechnung gemäß MaRisk (BTR 3.1 Tz. 5) vermittelt. Mit diesem Wissen können Sie die regulatorischen Vorgaben sicher in der Sparkasse umsetzen.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen des Controllings/Risikocontrollings, die für das System der internen Verrechnung der Liquiditätskosten ausgebildet werden.

IHR NUTZEN

- Sie haben ein fundiertes, praxisnahes Verständnis des Liquiditätskostenverrechnungssystems und können die regulatorischen Vorgaben sicher umsetzen.
- Sie sind mit den methodischen Grundlagen zum Prozess der Liquiditätskostenverrechnung gemäß MaRisk (BTR 3.1 Tz. 5) vertraut.

IHR REFERENT

Karsten Rauch, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen

HINWEIS(E)

Aufgrund unterschiedlicher Vorkenntnisse und regionaler Besonderheiten, die in dieser Veranstaltung berücksichtigt werden, empfehlen wir NRW-Sparkassen die Teilnahme am Termin 16. Juni 2026. Ihre Anmeldungen für diesen Termin erfolgen über die Sparkassenakademie Nordrhein-Westfalen.

Für Interessentinnen und Interessenten, die diesen Termin nicht wahrnehmen können, steht am 15. September 2026 ein allgemeiner Ausweichtermin für alle an der Kooperation Banksteuerung beteiligten Verbände (organisiert von der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen) zur Verfügung. Anmeldungen für diesen Termin nehmen Sie bitte direkt über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen vor. Zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen gelangen Sie über folgenden Link: Buchungsportal Sparkassenakademie Hessen-Thüringen

Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag
09:00 - 16:30 Uhr

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

In der Veranstaltung werden die methodischen Grundlagen zum Prozess der Liquiditätskostenverrechnung gemäß MaRisk (BTR 3.1 Tz. 5) vermittelt. Im Fokus stehen insbesondere

- **die aufsichtlichen Anforderungen,**
- **die institutsindividuelle Kategorisierung,**
- **die Grundlagen zur Ermittlung von Liquiditätsbeiträgen und -prämien sowie**
- **die Umsetzung in der Sparkasse.**

Die technische Umsetzung in der Kalkulation sowie in der Anwendung Gesamtbanksimulation (IDH-GBS) steht **nicht** im Fokus dieser Veranstaltung.

Methodische Grundlagen zum Internal Liquidity Adequacy Assessment Process (ILAAP)

Eine angemessene Liquiditätsausstattung der Institute sowie deren effektive Steuerung sind wesentliche Voraussetzungen für ein stabiles Finanzsystem. Als zentrale aufsichtliche Anforderung an die Institute wird daher die Einrichtung von internen Prozessen zur Sicherstellung einer angemessenen Liquiditätsausstattung verlangt. Die Verfahren und Prozesse zur Liquiditätsrisikosteuerung stehen im Fokus dieser Veranstaltung.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für eine Tätigkeit im Controlling/Risikocontrolling und die Messung sowie Steuerung der Liquiditätsrisiken ausgebildet werden

IHR NUTZEN

- Sie kennen die methodischen Grundlagen zur Beurteilung der Angemessenheit der Liquiditätsausstattung.
- Sie sind mit den Verfahren und Prozessen zur Liquiditätsrisikosteuerung auf der strategischen, taktischen und operativen Ebene vertraut.
- Sie können die ILAAP-Anforderungen in der Sparkassenpraxis umsetzen.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Jörg Rausmann, Sparkassenverband Westfalen-Lippe
  Referent im Kompetenz-Center Banksteuerung
- Melanie Schmacht, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband
  Referentin für Banksteuerung in der Abteilung Steuerung

HINWEIS(E)

Sofern Sie eine Übernachtung benötigen, können Sie ein Zimmer im direkt neben der Sparkassenakademie NRW gelegenen Hotel Hampton by Hilton (Faßstraße 3, 44263 Dortmund) buchen. Bitte buchen Sie Ihr Zimmer frühzeitig direkt beim Hotel (Telefon 0231 9479900). Bei Nennung des Buchungscodes "Sparkassenakademie NRW" erhalten Sie einen Rabatt auf die aktuelle Tagesrate. Weitere Kooperationshotels der Sparkassenakademie NRW finden Sie auf unserer Internetseite unter Tagungszentrum.

Für die Teilnehmer/-innen des Seminars wird am Abend des ersten Veranstaltungstages ein gemeinsames Abendessen im Umfeld der Akademie organisiert. Die Teilnahme ist optional und wird im Vorfeld separat abgefragt.

Die technischen Anwendungskomponenten in IDH-LQR und in IDH-GBS stehen nicht im Fokus der Veranstaltung. Die Anwenderschulungen wie z. B. "Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - SVP-Rechner" (Angebotsnummer 30.237) und "Grundlagen der Banksteuerung - Liquiditätsrisiko - LCR-Steuerer" (Angebotsnummer 30.238) stellen die Ergänzungen zu dieser Veranstaltung dar und vermitteln die technische Umsetzung im IDH.

TERMIN(E)

09.12.2026 – 10.12.2026 |
Sparkassenakademie NRW

DAUER

1,5 Tage

PREIS

645,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Tag 1: 10:00 – 16:00 Uhr
Tag 2: 09:30 – 14:00 Uhr

Methodische Grundlagen zum internen Prozess zur Beurteilung der Angemessenheit der Liquiditätsausstattung (ILAAP)

Institutsinterne Prozesse zur Identifizierung, Messung, Steuerung und Überwachung sämtlicher Liquiditätsrisiken auf den relevanten Ebenen (Strategie, Organisation, tägliche Prozesse)

30 BANKSTEUERUNG

Adressenrisikosteuerung

Grundlagen der Verlustschätzung unter Nutzung VDS in OSPlus

Gemäß Rundschreiben 06/2024 der BaFin zum Thema MaRisk vom 29.05.2024 (BTR 1 Tz. 7) hat jedes Institut eine angemessene Erfassung der Erlöse aus der Abwicklung von Kreditengagements sowie der zugehörigen historischen Werte der Kreditsicherheiten in einer Erlösquotensammlung zu gewährleisten. Die Erkenntnisse dieser Erlösquotensammlung sind bei der Steuerung der Adressenausfallrisiken angemessen zu berücksichtigen.

ZIELGRUPPE

Neue Mitarbeiter/-innen, die (künftig) mit der Verlustschätzung unter Nutzung der OSPlus-Anwendung VDS befasst sind (insbesondere aus den Bereichen Risikocontrolling, Kreditabwicklung und Interne Revision)

IHR NUTZEN

- Sie haben einen fachlichen Überblick über die Grundlagen der Verlustdatensammlung.
- Sie kennen den Umfang der OSPlus-Anwendung VDS und sind mit der Quotenberechnung und -validierung vertraut.
- Sie erfüllen mit einer vollständigen und qualitätsgesicherten Pflege der Verlustdatensammlung die aufsichtlichen Anforderungen an eine Erlösquotensammlung.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Anja Mikkelsen, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen
- Sandro Reichwald, Sparkassen Rating und Risikosysteme GmbH
- Ludger Trenkamp, Sparkassenverband Westfalen-Lippe

HINWEIS(E)

Diese Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten. Sie wird von der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen durchgeführt.

Anmeldungen für diese Veranstaltung nehmen Sie bitte direkt über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen vor. Ausführliche Informationen (z. B. Termin/e und Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen über folgenden Link: Buchungsportal Sparkassenakademie Hessen-Thüringen

Ihr Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

Es handelt sich ausdrücklich um eine Einsteigerveranstaltung.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1 Tag

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Grundlagen der Verlustdatensammlung (VDS)

Anwendung der VDS in OSPlus

Fachlicher Überblick über die zu sammelnden Verlustdaten

Quotenberechnung und -validierung

SR-Berichte zur Verlustdatensammlung (VDM und BBVS)

Grundlagen der Banksteuerung - Credit Portfolio View (CPV 5.93) (online)

Dieses Grundlagenseminar bietet einen fachlichen und methodischen Überblick der Berechnung von Adressrisiken im Rahmen der Risikosteuerung mit CPV. Die Veranstaltung ist für Neueinsteiger/-innen in das Themenfeld CPV konzipiert. Praxisdemonstrationen von CPV 5.93 und IDH-ADR sichern den Wissenstransfer in die Praxis.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen (Risiko-)Controlling, Banksteuerung und Revision, die erstmals mit der Software Credit Portfolio View arbeiten oder ihr Wissen auffrischen möchten

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen und methodischen Grundlagen der Adressrisikoberechnung mit CPV.
- Sie sind mit der grundlegenden Funktionsweise von CPV 5.93 vertraut.
- Sie können dieses Wissen in der Sparkassenpraxis anwenden.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Stephan Brandes, Sparkassenverband Niedersachsen
- Markus Hinz, S-Servicepartner Consulting GmbH
- Patrik Kreutzer, Ostdeutscher Sparkassenverband

HINWEIS(E)

Diese Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten. Sie wird von der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie durchgeführt.

Anmeldungen für diese Veranstaltung nehmen Sie bitte direkt über die Nord-Ostdeutsche Sparkassenakademie vor. Ausführliche Informationen (z. B. zum Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit zu den beiden Terminen in 2026 finden Sie im Buchungsportal der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie über folgende Links:

- 29.04. - 30.04.2026: Buchungsportal Nord-Ostdeutsche Sparkassenakademie
- 09.09. - 10.09.2026: Buchungsportal Nord-Ostdeutsche Sparkassenakademie

Ihre Ansprechpartnerin bei der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie ist Frau Luise Harder, Mail: luise.harder@nosa-online.de.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

1,5 Tage

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Methodische Grundlagen des Barwertmoduls von CPV 5.93

Funktionsweise des Adressenrisikomodells CPV (Makrosimulation, Mikrosimulation)

Wirkungsweise der verschiedenen Komponenten

Praxisdemonstration von CPV 5.93 und IDH-ADR

Die Schulung beinhaltet nur die Betrachtung des barwertigen Moduls von CPV 5.93. Auf das Periodikmodul wird nicht eingegangen.

Grundlagenschulung zum Bewertungsergebnis Kredit in GBS

Mit der Anwendung GBS steht den Sparkassen ein Instrument zur integrierten, szenarioabhängigen Simulation von Kennzahlen der Gesamtbanksteuerung - bezogen auf einen mehrjährigen Zeithorizont - zur Verfügung. In diesem Kontext ist GBS in der Lage, das Bewertungsergebnis Kreditgeschäft (z. B. Zuführung von Einzelwertberichtigungen oder Direktabschreibungen) sowie das adresseninduzierte Bewertungsergebnis Wertpapiergeschäft zu simulieren.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen des Controllings/Risikocontrollings, die für die Steuerung des Adressenrisikos in der normativen Sicht der RTF verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen und methodischen Hintergründe zur Ermittlung des Bewertungsergebnisses Kredit sowie des adresseninduzierten Bewertungsergebnisses Wertpapiergeschäft in GBS.
- Sie profitieren von konkreten Hinweisen für die Umsetzung in der Praxis.

VORAUSSETZUNG(EN)

Fachliche Grundlagen der Veranstaltung sind die zentralen Schulungsunterlagen der SR zur Thematik.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Tobias Schäffner, Sparkassenakademie Hessen-Thüringen
- Hendrik Hütten, Rheinischer Sparkassen- und Giroverband

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der "Nordkooperation" in Zusammenarbeit mit der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten.

Ein weiterer (inhaltlich identischer) Termin dieser Veranstaltung wird am 17.03.2026 (10: 00 - 17:00 Uhr) in Erfurt angeboten. Anmeldungen für diesen Termin sind über die Sparkassenakademie Hessen-Thüringen vorzunehmen. Zur Anmeldung im Buchungsportal der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen gelangen Sie über folgenden Link:

Link zur Anmeldung

Ansprechpartner bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen ist Herr Matthias Korte, Mail: matthias.korte@sgvht.de.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

1 Tag

PREIS

395,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Fachliche und methodische Hintergründe zur Ermittlung des Bewertungsergebnisses Kredit in GBS

Fachliche und methodische Hintergründe zur Ermittlung des adresseninduzierten Bewertungsergebnisses Wertpapiergeschäft in GBS

Überblick über die Datenstrecke

Praktische Umsetzungshinweise

Grundlagen zur Hard-Test-Meldung (online)

Mit der Anrechnung von wohnwirtschaftlichen und/oder gewerblichen Grundpfandrechten können Institute nach der Capital Requirements Regulation (CRR) niedrigere Risikogewichte für die Eigenkapitalhinterlegung nutzen (Privilegierung). Mit dem Hard-Test prüft die Aufsicht jährlich, ob Verluste aus ausgefallenen privilegierten Forderungen vorgegebene Verlustgrenzen einhalten.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für die Hard-Test-Meldung verantwortlich sind

IHR NUTZEN

- Sie kennen die fachlichen und methodischen Hintergründe zur Ermittlung der Meldedaten zum Hard-Test.
- Sie können die meldepflichtigen Daten mit Meldestichtag 31.12.2025 zum Meldetermin am 11.02.2026 anzeigen.

VORAUSSETZUNG(EN)

Fachliche Grundlagen der Veranstaltung sind die zentralen Schulungsunterlagen der SR.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

Anja Mikkelsen, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen

Kristina Nagel, Sparkassen Rating und Risikosysteme GmbH

HINWEIS(E)

Die Veranstaltung wird im Rahmen der "Nordkooperation" in Zusammenarbeit mit der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie, der Sparkassenakademie Niedersachsen und der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten. Sparkassen aus NRW melden ihre Teilnehmer/-innen bitte bei der Sparkassenakademie Nordrhein-Westfalen an.

TERMIN(E)

Auf Anfrage

DAUER

3 Stunden

PREIS

160,00 €

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Fachliche und methodische Hintergründe zur Ermittlung der Meldedaten zum Hard-Test

Vorgehensweise zur Meldung unter Berücksichtigung der SR-Rechenhilfe

Darstellung des Ablaufs im Zusammenspiel mit der Finanz Informatik

30 BANKSTEUERUNG

Steuerung operationeller Risiken

Grundlagen der Banksteuerung - Operationelle Risiken (OpRisk)

Welche aufsichtsrechtlichen Anforderungen existieren im Bereich der operationellen Risiken? Wie erfolgt die Integration operationeller Risiken in die Risikotragfähigkeit? Antworten auf diese und weitere relevante Fragen zum Umgang mit operationellen Risiken liefert dieses Grundlagenseminar.

ZIELGRUPPE

Mitarbeiter/-innen, die für die Steuerung operationeller Risiken aktuell oder zukünftig zuständig sind und u. a. die Verfahrensinstrumente Schadensfalldatenbank und OpRisk-Szenarien fachlich betreuen und die Quantifizierung in der ökonomischen und normativen Perspektive durchführen

IHR NUTZEN

- Sie kennen die Grundlagen zum Management der operationellen Risiken in der Sparkasse.
- Sie sind mit der Integration operationeller Risiken in die Risikotragfähigkeit vertraut.

REFERENTINNEN UND REFERENTEN

- Elena Miller, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen
- Markus Walter, Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen

HINWEIS(E)

Diese Veranstaltung wird im Rahmen der Kooperation Banksteuerung in Zusammenarbeit mit der Sparkassenakademie Niedersachsen, der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen und der Nord-Ostdeutschen Sparkassenakademie angeboten. Sie wird von der Sparkassenakademie Niedersachsen durchgeführt.

Anmeldungen für diese Veranstaltung nehmen Sie bitte direkt über die Sparkassenakademie Niedersachsen vor. Ausführliche Informationen (z. B. Termin/e und Preis) sowie die Anmeldemöglichkeit finden Sie im Buchungsportal der Sparkassenakademie Niedersachsen über folgenden Link: Buchungsportal Sparkassenakademie Niedersachsen

Ihre Ansprechpartnerin bei der Sparkassenakademie Niedersachsen ist Frau Petra Kauke, Mail: petra.kauke@svn.de.

TERMIN(E)

siehe Hinweise

DAUER

2 Tage

PREIS

siehe Hinweise

KONTAKT

ANMELDUNG



Christina Temmen
0231 22240-724
christina.temmen@ska.nrw

INHALTE



Robert Schulze
0231 22240-546
robert.schulze@ska.nrw

Programm/Inhalt

Definition und aufsichtliche Anforderungen

OpRisk-Aufbaustruktur

- Prozesse
- Verantwortlichkeiten und Kommunikation

Verfahrensinstrumente

- Schadensfalldatenbank
- OpRisk-Szenarien
- Datenpooling

Integration operationeller Risiken in die Risikotragfähigkeit

- OpRisk-Schätzverfahren inklusive der Plausibilisierungshandlungen
- OpRisk-Szenarioquantifizierung
- Ökonomische Perspektive
- Normative Sicht
- Fallbeispiel



DIE BUSINESS SCHOOL

Zertifizierte Weiterbildung zum Fach- oder Betriebswirt

Die Business School bietet zertifizierte Weiterbildungen zu Fach- oder Betriebswirten an. 100 % online und gleichzeitig persönlich betreut. Flexibel nach Deinen Wünschen, berufsbegleitend und europaweit auf Bachelor- und Master-Programme anrechenbar. Als Label der Sparkassenakademien Nordrhein-Westfalen verfügen wir über fundierte Erfahrungen in der Aus- und Weiterbildung – über 5.000 zufriedene Teilnehmerinnen und Teilnehmer haben mit uns schon ihre beruflichen Perspektiven verbessert.

Informiere Dich über unsere berufsbegleitenden Weiterbildungsangebote.

IHRE ANSPRECHPARTNER/-INNEN



Rabea Hesse
Bildungsberaterin Business School

0231 22240-712
bs@ska.nrw



Nathalie Mädje
Bildungsberaterin Business School

0231 22240-757
bs@ska.nrw



Liane Stach
Bildungsberaterin Business School

0231 22240-792
bs@ska.nrw



Laura Freiin von Eerde
Bildungsberaterin Business School

0231 22240-795
bs@ska.nrw



TAGUNGSZENTRUM HÖRDER BURG

Ob in Präsenz, digital oder hybrid: Mieten Sie unsere Räume für Ihre Veranstaltung

Kongress, Besprechung, Seminar, Workshop oder eigene Schulung für die Mitarbeitenden? Wir bieten Ihnen den passenden Raum für Ihre Veranstaltung.

Sie planen eine Online-Veranstaltung durchzuführen? Mit uns haben Sie den richtigen Partner an Ihrer Seite: Unsere digitalen Räume und hausinternes Studio bieten Ihnen die optimale Basis für Ihre digitale Veranstaltung. On top übernehmen wir für Sie auf Wunsch die professionelle Begleitung Ihrer Veranstaltung durch „Co-Moderatoren“, die Schulung Ihrer Dozenten, das gesamte Teilnehmermanagement, die inhaltliche Konzeption Ihrer Veranstaltung und vieles mehr.

Für Veranstaltungen in Präsenz erwarten Sie in dem exklusiven Gebäudeensemble der Hörder Burg mit direktem Seeblick über 40 hochmoderne Seminar- und Tagungsräume mit einmaligem Flair. Ein auf Ihre Bedürfnisse abgestimmtes Catering sowie hochprofessionelle Organisationsabläufe und maßgeschneiderte Rahmenprogramme runden unser Angebot perfekt ab.

Gern kombinieren wir auch das Raumangebot für Sie und führen Ihre Veranstaltung hybrid durch. Dabei ist ein Teil des Publikums physisch vor Ort, die weiteren Teilnehmer sind digital hinzugeschaltet. Der Vorteil: Das Online-Publikum wird aktiv in die Präsenz-Veranstaltung mit einbezogen und alle Teilnehmenden können in Echtzeit miteinander interagieren und in Kontakt treten.

Haben wir Ihr Interesse geweckt?

Unser Veranstaltungsmanagement berät Sie gern persönlich zu Ihrem individuellen Angebot.

IHRE ANSPRECHPARTNER/-INNEN



Antonia König
Veranstaltungsmanagement

0231 22240-744
antonia.koenig@ska.nrw



Andreas Gaida
Veranstaltungsmanagement

0231 22240-722
andreas.gaida@ska.nrw



MITTELSTANDSCAMPUS NRW

Der Mittelstand bildet das Herz der deutschen Wirtschaft

Der MittelstandsCampus NRW, eine Marke der Sparkassenakademie NRW, bietet mittelständischen Unternehmen vielfältige Bildungsangebote und Inhouse-Beratungen für zentrale Themen an, wie zum Beispiel:

· Nachhaltigkeit,
· Digitalisierung und
· Arbeitgeberattraktivität – Führung.

Ein exklusives Kooperationsnetzwerk, beispielsweise mit der Universität Witten/Herdecke oder der Hochschule für Finanzwirtschaft und Management, sichert zusammen mit unserer fundierten Erfahrung die Qualität der hochwertigen sowie einzigartigen Workshops, Bildungsformate und Beratungsleistungen.

Neben unseren digitalen Veranstaltungen begrüßen wir Sie und Ihre Mitarbeiter/-innen zudem in unserem Tagungszentrum Hörder Burg in einem einmaligen Ambiente. Von unserer rund 700 Jahre alten „Burg“ haben Sie einen direkten Blick auf den Phoenix See in Dortmund. Ein Ort, der wie kein anderer für Transformation und Zukunftsfähigkeit steht.

IHR ANSPRECHPARTNER



Christian Overhage
Projektleiter Mittelstandscampus NRW

0231 22240-717
christian.
overhage@mittelstandscampus-
nrw.de

Lern- und Buchungsportal

Informieren Sie sich über unser Bildungsangebot.

Digitale Transformation