

Unser Workshopprogramm 2026



Freuen Sie sich auch in diesem Jahr auf informative und abwechslungsreiche Workshops. Nutzen Sie die Gelegenheit zum Erfahrungsaustausch mit anderen Teilnehmenden und den Referierenden in den Pausen oder beim Get together.

Validierung interner Ratingsysteme*

11. und 12. Juni 2026 im nhow Hotel Frankfurt

- Grundlagen der PD-Validierung
- Validierung von PD-Prognosen mit Fallstudien:
 - Trennschärfemaße
 - Kalibrierung und Modellstabilität
- Modellrisiko und Herausforderungen der PD-Validierung in der Bankpraxis und Diskussion ausgewählter Probleme
- Methoden der LGD-/EAD-Modellierung
- Grundlagen der LGD-/EAD-Validierung
- Verfahren der LGD-/EAD-Validierung mit Fallstudien
- Vorgehensweise und Herausforderungen in der Praxis
- Herausforderungen der LGD-/EAD-Validierung in der Bankpraxis

Machine Learning und klassische statistische Methoden (Data Science) im Risikomanagement

13. November 2026 im nhow Hotel Frankfurt

- Data Science, Statistik, Machine Learning und Künstliche Intelligenz: Begriffe, Datenquellen und -strukturen, Einsatzbereiche und Potenziale, Methodenübersicht
- Aufsichtsrechtlicher Rahmen
- Unsupervised Learning
- Supervised Learning
- Explainable AI
- Einsatz in der Praxis, zukünftige Entwicklungen und Potenziale: Verknüpfung von Data Science und klassischen statistischen Methoden
- Spannungsfeld Regulatorik

Ihr Frühbuchervorteil

Melden Sie sich bis zum 30. Juni 2026 an und sichern Sie sich Ihren Frühbuchervorteil von bis zu 200 EUR!

* Beim Workshop „Validierung interner Ratingsysteme“ läuft der Frühbucherrabatt am 15. Mai 2026 aus!

Aufsichtsrechtliche Anforderungen an Ratingmodelle (PD und LGD)

21. Oktober 2026 im nhow Hotel Frankfurt

- Einführung in die Thematik
- Anforderungen der MaRisk und der CRR
- Der bankaufsichtliche Blick
- Anforderungen der EBA-Leitlinien für die PD-Schätzung, die LGD-Schätzung und die Behandlung von ausgefallenen Risikopositionen (EBA/GL/2017/16)

Entwicklung von PD- und LGD-/EAD-Modellen

22. und 23. September 2026 im Mövenpick Hotel Frankfurt City

- Grundlagen der Modellierung
- Modelle und Methoden zur Messung von PD und LGD
- Entwicklung von PD-Modellen
- Migrationsmatrizen und Mehrjahres-PDs
- Konjunkturabhängige Modellierung von Szenario- und Stresstestparametern in der Bankpraxis
- Entwicklung von LGD-/EAD-Modellen
- Modellrisiko und Herausforderungen der Modellierung in der Bankpraxis



Kreditportfoliomodelle

19. und 20. November 2026 im nhow Hotel Frankfurt

- Allgemeiner Aufbau von Kreditportfoliomodellen: Default-Mode und Mark-to-Market
- Modellierung wesentlicher Inputbausteine
- Modellierung und Messung von PD und Korrelationen
- Aufsichtsrechtliche Behandlung des Kreditrisikos: Kreditportfoliomodelle im Kontext der MaRisk mit anschließender Diskussion
- Kreditportfoliomodelle – Herausforderungen der Parametrisierung
- Praxisbeispiel eines Kreditportfoliomodells und Messung von Risikokonzentrationen
- Validierung von Kreditportfoliomodellen und Korrelationen
- Modellrisiko
- Diskussion: Einsatz von Kreditportfoliomodellen in der Praxis – Erfahrungsaustausch

Modellierung des Lifetime Expected Loss im Rahmen von IFRS 9 bzw. IDW RS BFA 7

24. September 2026 im Mövenpick Hotel Frankfurt City

- Grundlagen der Wertminderungsvorschriften nach IFRS 9 bzw. der Pauschalwertberichtigungen nach IDW RS BFA 7
- Migrationsmatrizen und Mehrjahres-PDs
- Modellierung von Point-in-Time-Parametern (PD, LGD und CCF) und makroökonomische Prognosemodelle
- Verknüpfung der Lifetime-Expected-Loss-Modellierung mit dem Stresstesting und der mehrjährigen Kapitalplanung

Inhouse-Trainings

Neben unseren Workshops bieten wir Inhouse-Trainings zu allen Aspekten unserer Beratungstätigkeit an. Rufen Sie uns an Tel.: +49 (0)941 899664-20 oder schreiben Sie uns unter info@risk-research.de. Wir beraten Sie gerne!

Ausgestaltung der RTF in ökonomischer und normativer Perspektive

22. Oktober 2026 im nhow Hotel Frankfurt

- Einführung in die Thematik – Überblick, historische Entwicklung und regulatorischer Kontext
- Deep Dive ökonomische Perspektive – Aufbau der Risikodeckungsmasse
- Deep Dive normative Perspektive – Kapitalplanung
- Zusammenspiel des ICAAP mit anderen Steuerungsaspekten
- Einbindung von ESG-Risiken in den ICAAP
- Aufsichtlicher Blick

Kontakt

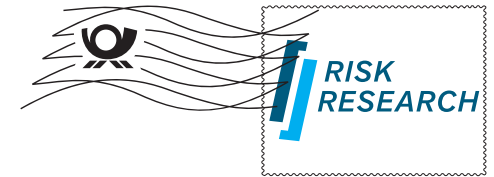
Ausführliche Informationen zu unseren Workshops finden Sie auf unserer Webseite unter risk-research.de. Schreiben Sie uns unter workshop@risk-research.de oder rufen Sie uns an unter +49 (0)941 899664-20.

Ihre Anmeldung

risk-research.de/anmeldung



WORKSHOPPROGRAMM 2026



ALLGEMEINES

Risk Research berät seit mehr als zwei Jahrzehnten erfolgreich Großbanken, mittelständische Institute, Kapitalverwaltungsgesellschaften sowie Factoring- und Leasinggesellschaften im Bereich Risikomanagement. Unsere Kernkompetenzen liegen hierbei im Kreditrisikomanagement und der Ausgestaltung von Risikotragfähigkeitskonzepten.

Zudem unterstützen wir unsere Kunden im Bereich Data Science – bei der Entwicklung datengetriebener Entscheidungssysteme, dem Einsatz maschineller Lernverfahren und Algorithmen sowie der zunehmenden Automatisierung von Prozessen und Auswertungen.

Darüber hinaus veranstalten wir regelmäßig fachspezifische Workshops und individuelle Inhouse-Trainings mit namhaften Dozent*innen aus Forschung und Praxis. Hierbei stehen aktuelle fachliche und aufsichtsrechtliche Entwicklungen im Risikomanagement sowie allgemeine Grundlagen des Risikomanagements im Fokus.

Unser Veranstaltungsprogramm wird kontinuierlich unter Berücksichtigung aktueller Trends und Ergebnisse in der Forschung weiterentwickelt.

Unsere Workshops bieten Ihnen folgende Vorteile:

- Expert*innen aus Forschung und Praxis vermitteln sorgfältig aufeinander abgestimmte Inhalte
- Direkter Erfahrungsaustausch zwischen Referierenden und Teilnehmenden aus Kreditinstituten, Bankaufsicht und Verbänden
- Hoher Praxisbezug durch Fachvorträge, Praxisberichte und Fallstudien

Mehr als 2.000 zufriedene Teilnehmende haben bislang unsere Workshops besucht. Nutzen auch Sie die Gelegenheit und melden Sie sich zu einem unserer Workshops an!

Wir freuen uns auf Sie!

Risk Research GmbH, Furtmayrstraße 3, 93053 Regensburg

Teilnahmegebühren

Die Teilnahmegebühr für die zweitägigen Präsenz-Workshops beträgt 1.790 EUR und für die Einzeltag-Buchungen 990 EUR. Dem zweiten Teilnehmenden eines Unternehmens werden 15% Preisnachlass auf die jeweilige Teilnahmegebühr gewährt. Ermäßigungen für weitere Teilnehmende auf Anfrage. Darüber hinaus erhalten Sie einen **Frühbucherrabatt** in Höhe von 200 EUR (Einzeltag-Buchungen 100 EUR) **bei einer Anmeldung bis zum 30. Juni 2026**. *Der Frühbuchervorteil für den Workshop „Validierung interner Ratingsysteme“ endet am 15. Mai 2026. Im Preis inbegriffen sind digitale Workshopunterlagen, ein Begrüßungskaffee, das Mittagessen und ganztägig Getränke sowie Snacks während der Kaffeepausen. Alle Preise verstehen sich pro Person und zzgl. 19% USt.

Teilnahmebedingungen

Nach Eingang der Anmeldung erhalten Sie eine Bestätigung, etwa eine Woche nach der Veranstaltung die Rechnung. Die Teilnahmegebühr ist nach dem Erhalt der Rechnung fällig. Die Stornierung ist bis 40 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenlos möglich. Bei Annullierung bis zum vierzehnten Tag vor Veranstaltungsbeginn wird die Hälfte der Teilnahmegebühr erhoben. Bei Absagen nach dem vierzehnten Tag wird der gesamte Betrag in Rechnung gestellt. Selbstverständlich ist eine Vertretung des angemeldeten Teilnehmenden jederzeit möglich. Ferner behält sich

der Veranstalter vor, Programmänderungen aus dringendem Anlass vorzunehmen sowie die Veranstaltung aus zwingenden Gründen abzusagen bzw. zu verlegen.

Ihre Daten

Verantwortlicher für diese Datenerhebung ist die Risk Research GmbH. Ihre im Anmeldeformular übermittelten Daten werden zur Erbringung vertraglicher Leistungen erhoben (Art. 6 Abs. 1 lit. b DSGVO), wie auch ggf. auf Basis Art. 6 Abs. 1 lit. a, c und f DSGVO, um eine reibungslose Abwicklung unserer Workshops zu gewährleisten. Weitere ausführliche Angaben, insbesondere zu Betroffenen- und Widerrufsrechten, zur Speicherdauer Ihrer Daten, zu Grundsätzen der Datenweitergabe und zur Verfügung stehenden Kontaktdaten unseres Datenschutzbeauftragten finden Sie auf unserer Webseite (risk-research.de/datenschutz-workshop)

Ihre Anmeldung

risk-research.de/anmeldung



Frühbuchervorteil bis zum 30. Juni 2026!*

ANMELDUNG

Telefon +49 (0)941/89 96 64-20

E-Mail workshop@risk-research.de

Internet risk-research.de/anmeldung

NEWSLETTER



Wenn Sie **keine postalische Werbung** mehr erhalten möchten, können Sie sich gerne zu unserem **kostenlosen Newsletter** anmelden. Darin informieren wir Sie regelmäßig über Neuigkeiten zu unseren Fokusthemen und Veranstaltungen sowie Entwicklungen rund um unser Unternehmen.

risk-research.de/newsletter

