

Aufsichtskonformes Modell-Risikomanagement



Risiko-Praxis-Seminar · 6 CPE-Punkte

- Aufsichtskonformer Umgang mit Modellen und Modellrisiken
- Schaffung stringenter und überprüfbarer Modellprozesse
- Steigende Anforderung an Konsistenz und Robustheit der Modelle
- Vorgehen bei regelmäßiger und unabhängiger Modellvalidierung
- Risikoklassifizierung von Modellen als zentrales Steuerungsinstrument
- Besondere Herausforderungen bei regulatorisch sensiblen Modellen (z. B. RTF, ICAAP, Stresstests, IRRBB)

Referenten



Denis Lippolt
Director, Service Line Lead
Advanced Analytics
Protiviti GmbH, Frankfurt/Main



Florian Mauer
Associate Director, Service Line
Lead Advanced Analytics
Protiviti GmbH, Frankfurt/Main

Programm

Denis Lippolt & Florian Mauer, Protiviti

9:00–17:00 Uhr – inkl. Kaffeepausen und ca. 45 Min. Mittagspause

Einführung

- **Begriffsbestimmungen:**
Unterschiedliche Modelldefinitionen in internationalen und nationalen Vorgaben führen zu Unsicherheiten bei der institutsweiten Einordnung von Modellrisiken
- **Rechtliche Grundlagen:**
Ob nationale MaRisk-Vorgaben oder internationale Vorgaben durch CRR, EBA guidelines on internal governance and risk management und ECB guide to internal Models, alle fordern stringente, überprüfbare Modellprozesse

Modell-Entwicklung und Modell-Validierung im Fokus der Aufsicht

- **Prüfung von Prozessen:**
Vollständige, nachvollziehbare Prozessketten – Defizite bei Genehmigungen, Änderungen, Validierungen und Dokumentation als häufige Prüfungsfeststellungen
- **Modellentwicklungsanforderungen:**
Anforderungen an Konsistenz, Robustheit und Replizierbarkeit steigen – Unsicherheiten bei der Berücksichtigung aufsichtsrelevanter Rahmenvorgaben
- **Modellvalidierungsanforderungen:**
Validierungen müssen risikoorientiert, regelmäßig und unabhängig erfolgen – häufige Schwächen bei Abdeckung, Tiefe und Methodenkritik
- **Rolle der Internen Revision:**
Modellrisiken geraten zunehmend in den Fokus der Revision – fehlende Prüfstandards und begrenzte Modellkenntnisse erschweren eine wirksame Prüfung

Modellrisikomanagement im Aufsichts-Fokus

- **Model Governance:**
EBA und EZB fordern klare Zuständigkeiten, Eskalationswege und einheitliche Rahmenwerke – Notwendige Anpassung der oft noch unzureichenden Strukturen in den Instituten
- **Model Lifecycle:**
Steuerung des vollständigen Modell-Lebenszyklus – Entwicklung, Anwendung, Anpassung und Stilllegung häufig nicht systematisch und prozessseitig verankert
- **Model Risk Rating:**
Risikoklassifizierung von Modellen als zentrales Steuerungsinstrument – häufig fehlende einheitliche Bewertungslogik erschwert Priorisierung und risikogerechte Ratings
- **Spezielle Modelle und deren Anforderungen:**
Herausforderungen bei regulatorisch sensiblen Modellen (z. B. RTE, ICAAP, Stresstests, IRRBB) – erhöhte Anforderungen an Nachvollziehbarkeit, Datenqualität und Dokumentation
- **Konkrete Beispiele für spezielle Modelle und deren Anforderungen**
- **Praxis-Hinweise, Projekt-Erfahrungen und Umsetzungstipps für ein aufsichtskonformes Modellrisikomanagement**

Gute Gründe für Ihre Teilnahme

- Sie erarbeiten sich aktuelles Know-how zu spezifischen Anforderungen an den Einsatz von Risikomodellen
- Sie erhalten sofort anwendbare Umsetzungstipps für Ihr Institut
- Sie klären offene Fragen mit den erfahrenen Praxis-Referenten und erhalten wertvolle Praxistipps im Erfahrungsaustausch mit anderen Praktiker*innen

Seminarziel

Modelle sind aus dem modernen Bankbetrieb nicht mehr wegzudenken – sei es für Kreditrisiken, Stresstests, Pricing oder Kapitalplanung. Doch mit der zunehmenden Bedeutung von Modellen steigt auch das Risiko: Falsche Annahmen, schlechte Datenqualität oder unzureichende Validierung können gravierende Folgen haben – für die Risikosteuerung ebenso wie für die aufsichtsrechtliche Reputation. Die Aufsicht hat daher reagiert: Anforderungen wie MaRisk, TRIM, die EBA-Guidelines on Model Risk Management oder das neue ECB-Guide on MRM erhöhen den Druck auf Institute, ein strukturiertes, dokumentiertes und wirksam kontrolliertes Modell-Risikomanagement zu etablieren.

Viele Banken und Finanzdienstleister stehen vor der Herausforderung, Modelle nicht nur methodisch weiterzuentwickeln, sondern auch die organisatorischen und prozessualen Anforderungen zu erfüllen – oft ohne klare Standards oder mit begrenzten Ressourcen. Wie lassen sich Modellrisiken identifizieren, messen und begrenzen? Welche Governance-Strukturen sind erforderlich? Und wie gelingt eine aufsichtsrechtlich belastbare Validierung?

Das Seminar bietet praxisnahe Orientierung und zeigt, wie Institute ein aufsichtskonformes Modell-Risikomanagement aufbauen und effizient umsetzen können.

Zielgruppe

Aus der Praxis für die Praxis!

Wir wenden uns insbesondere an die Mitarbeitenden der Bereiche:

- Risikocontrolling und Risikomanagement
- Modellentwicklung und -validierung
- Compliance, Regulatorik und Grundsatz
- Interne Revision und Steuerungsrevision
- IT und Datenmanagement, Controlling und Gesamtbanksteuerung
- Sowie andere interessierte Fachbereiche, Vorstandsmitglieder und Geschäftsleitung, externe Prüferinnen und Prüfer und Bankdienstleister

Unsere Referenten



Denis Lippolt

Director, Service Line Lead Advanced Analytics
Protiviti GmbH*, Frankfurt/Main

Denis Lippolt ist Diplom-Mathematiker und Segment Lead für Advanced Analytics in der Risk & Compliance Solution bei Protiviti Deutschland, wo er seit 2010 Finanzinstitute berät. Er ist Experte für mathematische Modellierung, Data Science, Risikomanagement und Modell-Risikomanagement und leitete zahlreiche Projekte, u. a. Model Audits bei internationalen Großbanken sowie Beratungen zu Risikotragfähigkeit und MaRisk-Prozessen. Zudem ist er zertifiziert in Financial Risk Management und ITIL.



Florian Mauer

Associate Director, Service Line Lead Advanced Analytics
Protiviti GmbH*, Frankfurt/Main

Florian Mauer ist seit Anfang 2015 bei der deutschen Risiko- und Compliance-Abteilung von Protiviti mit Schwerpunkt auf finanzmathematischen Modellen und Datenanalysen tätig. In seiner Zeit bei Protiviti hat er erfolgreich verschiedene Risikomanagement- und Prüfungsaufträge für mehrere nationale und internationale Finanzinstitute sowie Industriekunden durchgeführt und unterstützt. Er hat einen Master of Science in Quantitative Economics sowie einen Bachelor of Science in Wirtschaftswissenschaften. Bevor er zu Protiviti kam, arbeitete er in der Asset Management Abteilung der Commerzbank AG.

** Die Referenten geben ausschließlich ihre persönliche Auffassung und nicht die eines bestimmten Instituts, der Bundesbank, der BaFin oder einer anderen Aufsichtsbehörde wieder. Die Referenten nehmen auch keine offizielle aufsichtliche Auslegung regulatorischer Sachverhalte vor.*

Risikomanagement im Fokus der Aufsicht
23. September 2026, Online-Veranstaltung

Projektbegleitung & Projektprüfungen
durch die Interne Revision
29. September 2026, Online-Veranstaltung

Anforderungen an die Datenqualität (DQM)
und Beurteilung der Data-Governance
5. Oktober 2026, Online-Veranstaltung

ESG-Risikomanagement, Nachhaltigkeits-Controlling
und Sustainability-Scorings in der Praxis
6. Oktober 2026, Online-Veranstaltung

Risikoinventur im Fokus
14. Oktober 2026, Online-Veranstaltung

Aufbau eines aufsichtskonformen und revisionssicheren
Internen Kontrollsystems (IKS)
22./23. Oktober 2026, Online-Veranstaltung

OpRisk SPEZIAL: IKT-Risiken im Fokus
2. November 2026, Online-Veranstaltung

► Diese und weitere Seminar-Angebote finden Sie bei uns
online unter www.akademie-heidelberg.de/online-seminare

Zusätzliche Informationen

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



Björn Wehling
Telefon 06221/65033-44
b.wehling@akademie-heidelberg.de

Anmeldeformular
Aufsichtskonformes
Modell-Risikomanagement

Name
Vorname
Position
Firma
Straße /Nr.
PLZ / Ort
Telefon
E-Mail
Name der Assistenz
Datum/Unterschrift

Senden Sie Ihre Anmeldung bitte an: anmeldung@akademie-heidelberg.de

Termin und Seminarzeiten

Donnerstag, 15. Oktober 2026
9:00–17:00 Uhr
Online-Zugang ab 8:45 Uhr
Seminar-Nr. 26 10 BA197 W

Teilnahmegebühr

€ 490,- (zzgl. gesetzl. USt)

Die Gebühr beinhaltet die Teilnahme am
Online-Seminar sowie die Präsentation
als PDF-Datei.
Im Anschluss an das Seminar erhalten Sie
ein Zertifikat, das Ihnen die Teilnahme an
der Fortbildung bestätigt.

Allgemeine Geschäftsbedingungen

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

Zum Ablauf

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



AH Akademie für Fortbildung Heidelberg GmbH
Maaßstraße 32/1 · 69123 Heidelberg
Telefon 06221/65033-0
info@akademie-heidelberg.de
www.akademie-heidelberg.de