

Inhouse Seminarreihe 2017 für die Revision

www.exbase.de/banken

Wählen Sie Ihr maßgeschneidertes Seminarprogramm
aus folgenden Themen:

Liquiditätssteuerung unter CRR

Marktpreisrisiken nach FRTB

Kontrahentenrisiken

MiFID II

MaRisk-Novelle

CRR 2 und CRD V

weitere aktuelle Themen

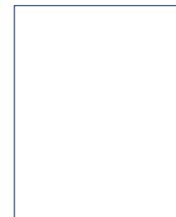
Ihre Referenten



Prof. Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University



Dr. Sven Ludwig
Managing Director,
FIS GLOBAL



weitere Referenten je
nach Anforderung

Die Durchführung einer 3-tägigen Seminarreihe in 2017 bei einer Landesbank wurde im Schnitt mit **9 von 10 möglichen Punkten** bewertet.

Liquiditätssteuerung unter CRR

Marktpreisrisiken nach FRTB

www.exbase.de/banken

SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Seminar befassen Sie sich mit aktuellen Herausforderungen der Liquiditätssteuerung. Neben den zusätzlichen Liquiditätsmetriken (ALMM) wird auch die NSFR thematisiert. Die Säule 2 - Stresstests und deren Zusammenspiel mit der LCR werden im dritten Abschnitt besprochen. Wie die einzelnen Bausteine zu einer effektiven Liquiditätssteuerung zusammenzuführen sind, wird im vierten Abschnitt gezeigt.

AGENDA

09.00

Liquiditätssteuerung

- Einordnung wichtiger Liquiditätsbegriffe: LCR, NSFR, ILAAP etc.
- Integrierte Liquiditätssteuerung: Komponenten, Verzahnung, Zuständigkeiten, Erwartungshaltung der Aufsicht

10.30 Kaffeepause

10.45

Additional Liquidity Monitoring Metrics (ALMM)

- Komponenten: Concentration of Funding, Prices, Rollover Rates
- Liquiditätsablaufbilanz (Maturity Ladder, C66, Draft RTS)
- Konstruktion, Probleme, Überschneidungen mit sonstigen Reports
- Umgang mit stochastischen Zahlungsströmen

12.15 Mittagspause

13.30

Liquiditätsstresstests: Definition von Stressszenarien

- Qualitative Anforderungen
- Kriterien für effektive Stresstests
- Szenariodefinition
- Aufsichtliche Erwartungen

15.00 Kaffeepause

15.15

Net Stable Funding Ratio

- NSFR in CRR 2
- Abweichungen NSFR (CRR 2) vs. NSFR (Basel III)
- Einbindung in die Steuerung
- Verzahnung mit der täglichen Liquiditätssteuerung

17.00 Ende des Seminars

SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Seminar werden ausgewählte Details zur Marktpreisrisikoreform (FRTB) thematisiert. Maßgebliche Grundlage ist die bisherige Umsetzung im CRR 2 - Vorschlag zur Handels-/Bankbuchabgrenzung und für die internen Risikotransfers. (Falls Sie nur den Standardansatz nutzen, bieten wir Ihnen gerne eine halb- oder ganztägige Veranstaltung zu diesem Thema an.)

AGENDA

09.00

Fundamental Review of the Trading Book (Teil I)

- Standardansatz: methodische Herleitung
- Internes Modell: methodische Herleitung
- Standardansatz und internes Modell: Auswirkungen auf die EK-Belastung

10.30 Kaffeepause

10.45

Fundamental Review of the Trading Book (Teil II)

- FRTB (CRR 2) vs. FRTB (BCBS 352)
- Einteilung HB – AB: Abgrenzungskriterien und -implikationen
- Bankbuchhedging über das Handelsbuch (IRT Desk)

12.15 Mittagspause

13.30

Herausforderungen bei der Implementierung

- Standardansatz: Sensitivitäten, Bucketing
- Internes Modell: P&L - Test, nicht modellierbare Risikofaktoren

15.00 Kaffeepause

15.15

RWA-Berechnung und Handelstischstruktur

- Big Picture: wie viele RWA-Berechnungen sind notwendig?
- Handelstischstruktur optimieren?
- Weitere Anforderungen

17.00 Ende des Seminars

Kontrahentenrisiken

www.exbase.de/banken

SEMINARBESCHREIBUNG

Das Seminar behandelt die Gegenparteirisiken von Derivaten. Hinführend zum Thema werden Risiken von Finanzinstrumenten kurz allgemein thematisiert. Anschließend werden für die Kontrahentenrisiken die unterschiedlichen Ausprägungen und deren Wechselspiel mit Besicherungsmechanismen im Detail behandelt und ausgewählte Aspekte wie PFE und DVA diskutiert.

AGENDA

09.00

Universum der Finanzinstrumente

- Bonds, Aktien, Forwards, Futures, Optionen...
- Welche Risiken können Finanzinstrumente enthalten?
- Finanzinstrumente aus regulatorischen Gesichtspunkten

Kontrahentenrisiken und Kapitalunterlegung

- Kontrahentenrisiken
 - Kurze Einführung: Wie entstehen "Kontrahentenrisiko" und "Exposure"?
 - Kapitalunterlegung (Übersicht)
 - Reduzierung (Netting, Besicherung, CDS)
- Kapitalunterlegung: Ausfall- und Migrationsrisiken
 - Berechnung Kreditäquivalenzbetrag: heute & unter CRR 2 (= SA-CCR)
 - Was bedeutet in diesem Zusammenhang das "Wrong Way Risk"?

10.30 Kaffeepause

10.45

Derivate - Collateral Management

Regulatorischer CVA / CVA Risk Charge

12.15 Mittagspause

13.30

Valuation Adjustments (CVA, DVA und weitere XVA)

- CVA und seine Ursprünge
- Credit Quality und Credit Spread
- Wichtige Exposuremaße
- Simulationsbasierte CVA-Berechnung
- Implikationen von CVA
- Inkrementelles CVA und Allokation von CVA

15.00 Kaffeepause

15.20

Die Entwicklung von CVA zum XVA Puzzle

- Implikationen von EMIR (Bilaterales Clearing, Zentrales Clearing)
- Sinn und Zweck der XVAs
- Schritte zum Collateral Transfer Pricing
- Verbindung zu SA-CCR

Steuerungsrahmen

- Wie erfolgt die traditionelle Steuerung mithilfe von Limiten?
- Regulatorisches Kontrahentenrisiko (SA-CCR) und Steuerung mit Limiten
- Limitenstrukturen und notwendige Prozesse
- MtM+Addon versus Monte Carlo
- Modellierung des PFE mithilfe von Monte-Carlo-Simulationen
- CVA versus PFE
- Auswirkungen des Close-Out-Nettings auf die Modellierung des PFE
- Welche Methoden eignen sich zum Backtesting des PFE?
- Standardmodell SA-CCR versus Interne Modellmethode (IMM). Einblicke in die Auswirkung der Eigenkapitalanforderungen

16.50 Ende des Seminars

MiFID II

Praxisseminar anlässlich der Einführung der MiFID II zum 03.01.2018

www.exbase.de/banken

SEMINARBESCHREIBUNG

Dieser Seminarvorschlag wurde für die interne Revision erstellt. Schwerpunkte der Veranstaltung sind unter anderem die neuen Anforderungen an Berater und die Beratung, an das Interessenkonfliktmanagement und die Vergütung sowie an die Product Governance.

AGENDA

TAG 1

09.00

Einführung in die wesentlichen Neuerungen

- Anlass der Neufassung MiFID II
- Zeithorizont und Umsetzungsfristen
- System der Delegierten Rechtsakte
- Neue Pflichten zur Kundeninformation

10.30 Kaffeepause

10.45

Auswirkungen der MiFID II auf einzelne Wertpapierdienstleistungen

- Anlageberatung, Abgrenzung zur unabhängigen Anlageberatung (Honoraranlageberatung)
- Vermögensverwaltung und Asset Management
- Anlagevermittlung

12.15 Mittagspause

13.30

Neuregelung Interessenkonfliktmanagement

- Qualifikationsanforderungen an die Mitarbeiter in der Anlageberatung, Vertriebsmitarbeiter und Mitarbeiter in der Finanzportfolioverwaltung
- Conflict of Interest
- Neuregelung Best Execution, nichtkomplexe Finanzinstrumente

15.00 Kaffeepause

15.15

Provisionen, Research, Kundeninformation

- Provisionen, Zuwendungen, Retrozessionen mit Fallstudien
- Neuregelung Researchbezug
- Neuregelung zur Kundeneinstufung

17.00 Ende des ersten Seminartages

TAG 2

09.00

Product Governance

- Konzeption von Product Governance
- Pflichten für Manufacturer und für Vertreiber

10.30 Kaffeepause

10.45

Kostentransparenz

- Ex-ante Kostentransparenz
- Ex-post Kostentransparenz
- Datenformate, Datenversorgung, Dateninfrastruktur zur Erfüllung der Kostentransparenzpflichten

12.15 Mittagspause

13.30

Spezialthemen

- PRIIPS im Zusammenhang mit MiFID II
- Vergleich IDD und MiFID
- Ausnahmeregelung Fondsvertrieb, Finanzanlagenvermittler, Haftungsdach

15.00 Kaffeepause

15.15

Transparenz Wertpapiermärkte

- Plattformzwang für Derivate, Emissionsrechte und Bonds
- Vorgaben für liquide Märkte
- Systematische Internalisierer
- Neuregelungen für Informationsdienste

17.00 Ende des Seminars

DIESE VERANSTALTUNG BIETEN WIR IHNEN GERNE MIT EINEM DER PROFILIERTESTEN EXPERTEN IM FINANZVERTRIEBSRECHT AN.

Bezüglich der Dauer und Inhalte unserer Seminarprogramme richten wir uns nach Ihren individuellen Anforderungen.

MaRisk - Novelle

www.exbase.de/banken

SEMINARBESCHREIBUNG

Die neue MaRisk-Novelle ist auf dem Weg. Damit reagiert die BaFin auf aufsichtliche Entwicklungen und Publikationen von internationalen Regulatoren. Die neu aufgenommenen Anforderungen zur Risikokultur, Auslagerungen und Datenverwaltung stehen im Mittelpunkt des Seminars. Darüber hinaus werden kleinere Änderungen diskutiert, die mitunter große Wirkung entfalten können. Hierzu gehören die Änderungen bei den Adressausfall-, Liquiditäts- und operationellen Risiken.

AGENDA

09.00

Die MaRisk-Novelle

- MaRisk zwischen SREP und SSM: noch Platz für eine deutsche Ausnahme?
- Neuerung der MaRisk-Novelle im Überblick
- Details:
 - Risikokultur – was heißt das in der Praxis?
 - Anforderungen an die Erstellung der Risikoberichte für große Institute

10.30 Kaffeepause

10.45

Neue Anforderungen im Detail für:

- Stresstests
- Das Kreditgeschäft: Forbearance Maßnahmen
- Outsourcing
- Risikoberichterstattung
- Verbot der Selbstprüfung und -überprüfung
- Interne Revision: Veränderungen bei der Prüfungsplanung und -durchführung sowie der Berichterstattung
- Kreditrisiken (Erlösquoten)
- Zinsänderungsrisiken im Anlagenbuch
- Operationelle Risiken und Liquiditätsrisiken

12.15 Ende des Seminars

CRR 2 und CRD V

www.exbase.de/banken

SEMINARBESCHREIBUNG

Ende 2016 wurde die Konsultationsversion der CRR 2 und CRD V veröffentlicht. Wie bei ihren Vorgängern sind weitreichende Anpassungen in Systemen, Methoden und Prozessen zu erwarten. Im Seminar erfahren Sie, welche neuen Anforderungen auf Sie zukommen und welcher Handlungsbedarf daraus resultiert. Ziel der Veranstaltung ist es, einen Leitfaden zu geben, der wichtige Informationen für strategische Entscheidungen zu Projekten und Budgets liefert.

AGENDA

09.00

CRR 2 & CRD V: Überblick der Änderungen und Zeitplan der Umsetzung

Im ersten Block werden Ihnen die zahlreichen Neuerungen im Gesamtkontext vorgestellt. Dabei wird auch auf aufsichtliche Initiativen eingegangen, die in der CRR 2 & CRD V noch keine Berücksichtigung fanden.

10.30 Kaffeepause

10.45

Details der Änderungen und Handlungsbedarf (Teil I)

- Waiver / Ausnahmen von Kapital- und Liquiditätsanforderungen
- Standardansatz für Risikolumina bei Gegenpartei Risiken
- Forderungen gegen zentrale Gegenparteien

12.15 Mittagspause

13.30

Details der Änderungen und Handlungsbedarf (Teil II)

- Markpreisisiken (FRTB)
- Großkredite
- Verschuldungsquote
- Meldewesen
- Offenlegung
- NSFR
- IFSR 9
- SME Erleichterung bei Kapitalunterlegung
- Projektfinanzierungen
- Investmentgesellschaften
- Zinsänderungsrisiko im Bankbuch

(inkl. Kaffeepause)

17.00 Ende des Seminars

REFERENTEN



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Professor für Finance an der Aarhus University. In Lehre und Forschung befasst er sich intensiv mit der Steuerung und Regulierung von Banken. Während seiner Tätigkeit als Consultant bei True North Partners betreute er viele europäische Banken im Risikomanagement und in der Umsetzung regulatorischer Anforderungen. Als gefragter Referent spricht er regelmäßig auf Konferenzen und gibt Seminare zu aufsichtsrechtlichen Themen.



Dr. Sven Ludwig verantwortet als Managing Director und Head of Subject Matter Expert Risk & Analytics EMEA das Business Development insb. für den Risikomanagementbereich von FIS Global. Weiterhin ist er Regional Director bei der Professional Risk Managers' International Association (PRMIA) in Deutschland. Zuvor arbeitete er als IT-Verantwortlicher für Trade- und Risk-Management und Investment-Services bei der Deutschen Apotheker- und Ärztebank eG. Sven Ludwig ist außerdem Mitherausgeber eines Buches zum Thema Kontrahentenrisiko und Credit-Valuation-Adjustment (CVA).

Neben den obengenannten Referenten arbeiten wir mit weiteren Experten zusammen. Je nach Thema und Anforderungen, bieten wir Ihnen die Schulung mit dem/den Referenten an, die unserer Ansicht nach die Inhalte bestmöglich vermitteln.

SEMINARUNTERLAGEN

Alle Teilnehmenden erhalten die Präsentation als Ringbuch. Somit können Sie die Inhalte auch nach Besuch der Veranstaltung gut nachvollziehen. Um nahe an den Originalpublikationen zu bleiben, sind die Präsentation und Seminarunterlagen von Prof. Dr. Schmaltz und Dr. Sven Ludwig in englischer Sprache verfasst. Referiert wird auf Deutsch.



WER SOLLTE TEILNEHMEN?

Diese Seminarreihe haben wir für die interne Revision erstellt. Die Themen sind auch für andere Abteilungen relevant und können an deren Anforderungen angepasst werden.

ABLAUF DER KONZEPTION UND BUCHUNG

Die im Flyer beschriebenen Seminare sind als Vorschläge zu betrachten. Um Ihnen ein individuelles Programm zu erstellen, können wir uns an den Inhalten orientieren, Themen streichen und ergänzen.

Nach Absprache erhalten Sie einen maßgeschneiderten Seminarvorschlag und ein Angebot. Anschließend können wir das Programm im Detail abstimmen, bis dieses möglichst gut Ihren Anforderungen gerecht wird.

FEEDBACK ZU UNSEREN SEMINAREN

„Herr Dr. Schmaltz versteht es, das Seminar auf die Bedürfnisse der Gruppe anzupassen.“

Florian Mumme, Verhinderungsvertreter des Leiters Revision Financial Markets, Nord/LB

„Sehr gute praxisrelevante Darstellung des Themas, mit Berücksichtigung und Erörterung angrenzender Themen.“

J. Lindenberg, TXS GmbH

„Sehr gute Vermittlung der LCR mit sehr hohem praktischen Bezug.“

Eugen Rabe, Regulatory Analytics&Policies, Commerzbank AG

[\(Seminar: LCR-Steuerung\)](#)

„Sehr empfehlenswertes Training.“

Tobias Eggersdorfer, Manager, Finalix Business Consulting, Zürich.

[\(Seminar: Basel IV\)](#)

„Gute Einführung in die Details des FRTB-SBA - mit Raum für Diskussion und Fragen.“

Holger Fullriede, Revision Risikosteuerung/Verfahren, Nord/LB

[\(Seminar: Der sensitivitätsbasierte Standardansatz\)](#)

„Die Rechnung von Rechenbeispielen vertieft effektiv die präsentierten Inhalte.“

Nedas Kaucikas, Revision Financial Markets, Nord/LB

[\(Seminar: Der sensitivitätsbasierte Standardansatz\)](#)

BEI INTERESSE UND FRAGEN ZUM PROGRAMM KONTAKTIEREN SIE MICH GERNE DIREKT:

Sven Wiessner

Geschäftsführer Exbase

Exbase

Hindenburgstraße 2

78467 Konstanz

Phone: +49 (0)7531 922 82 33

E-Mail: sven.wiessner@exbase.de

Web: www.exbase.de