

Basel IV / Post-Crisis Regulation

Kredit-, Marktpreis-, Zinsänderungs- und operationelle Risiken

www.exbase.de/ba

In dieser Veranstaltung erhalten Sie einen fundierten Überblick zu den neuen Standardansätzen.

Themen des Seminars

- Neuer Standardansatz zum Kreditrisiko (BCBS 347)
- Neuer Standardansatz zum Marktpreisrisiko (CRR II)
- Neuer Standardansatz zum operationellen Risiko (BCBS 355)
- Neuer Standardansatz zum Zinsänderungsrisiko (BCBS 368, EBA IRRBB Richtlinien)
- Kapitaluntergrenzen (BCBS 306)

Ihr Seminarleiter



Prof. Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University

Termine

- 21. Juni 2018, Frankfurt am Main
- 06. Dezember 2018, Frankfurt am Main
- 03. Juni 2019, Frankfurt am Main

SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Seminar erhalten Sie einen kompakten Überblick über anstehende Neuregelungen im Management der Kredit-, Markt- und operationellen Risiken (inkl. Excelbeispiele). Darüber hinaus wird das Zusammenspiel zwischen den Standardansätzen und den internen Modellen mittels potentieller Floors veranschaulicht. Einen weiteren Schwerpunkt bilden der neue Standardansatz zu den Zinsänderungsrisiken im Bankbuch und die MREL-Quote. Das Seminar wird Ihnen helfen, die Kapitalauswirkungen der Basel IV - Regelungen für Ihr Haus abzuschätzen.

AGENDA

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

09.00

Beginn der Veranstaltung

- Begrüßung und Programmübersicht
- Abstimmung der Seminarinhalte mit den Teilnehmenden

09.15

Von Basel III zu Basel IV

- Überarbeitung der Standardansätze (Kreditrisiko, Marktrisiko, OpRisk)
- Neuer Standardansatz zum Zinsänderungsrisiko im Bankbuch
- Zwingende Berechnung der Standardansätze durch alle Banken
- Kapitaluntergrenzen und MREL

10.30 Kaffeepause

10.45

Neuer Standardansatz zum Kreditrisiko (Kapitalunterlegung pro Kundesegment)

- Segment Banken
- Segment Unternehmen
- Segment Privatkunden
- Beispielrechnungen
- Vergleich zum heutigen Standardansatz

12.15 Mittagspause

13.30

Neuer Standardansatz zum Marktpreisrisiko

- Überblick zum Reformpaket „Marktpreisrisiken im Handelsbuch“
- Der sensitivitätsbasierte Ansatz
- Aufsichtliche Stresskalibrierung: Risikogewichte und Diversifikationspotentiale
- Datenanforderungen
- Stolpersteine bei der Implementierung

Neuer Standardansatz zum operationellen Risiko

- Der Abschied vom internen Modell
- Die verbleibenden erweiterten Modelloptionen
- Annahmen und Datenanforderungen
- Vergleich zum heutigen Standardansatz

15.00 Kaffeepause

15.15

Neuer Standardansatz zum Zinsänderungsrisiko im Bankbuch

- Zielsetzung und Reformnotwendigkeit
- Mechanik des Ansatzes
- Barwertiger vs. Periodischer Ansatz
- Datenanforderungen

MREL - Zusätzliche Kapitalanforderungen

- Kontext und Zielsetzung
- Berechnungsoptionen
- Datenanforderungen
- Auswirkungen auf Produkt- und Preisspektrum

Zusammenfassung und Ausblick

17.00 Ende des Seminars

IHR SEMINARLEITER



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Assistant 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. Immer nah an der Praxis berät er jährlich viele Finanzinstitute und Beratungsunternehmen im Rahmen von Konferenzen und Seminaren.

PRÄSENTATION, SEMINARUNTERLAGEN UND NACHBETREUUNG

Alle Teilnehmenden erhalten ein Handout, mit dem sie die Inhalte des Seminars gut nachvollziehen können. Um nahe an den Originalpublikationen zu bleiben, sind Präsentation und Seminarunterlagen in englischer Sprache verfasst. Herr Schmaltz referiert auf Deutsch.

Gerne steht Ihnen unser Referent für drei Monate nach dem Seminar in gewissem Umfang für Fragen zu den Seminarinhalten zur Verfügung.

WER SOLLTE TEILNEHMEN?

Dieses Seminar richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus Banken und Sparkassen sowie anderen Finanzdienstleistungsunternehmen mit folgenden Schwerpunkten:

- Treasury
- Risikocontrolling
- Aufsichtsrecht
- Meldewesen
- Revision

Gerne erstellen wir Ihnen zu den Themen des Seminars auch eine individuelle interne Schulung.

FEEDBACK ZUM SEMINAR

„Sehr empfehlenswertes Training.“

Tobias Eggersdorfer, Manager, Finalix Business Consulting, Zürich.

Die Präsentation von Prof. Dr. Schmaltz wurde im Schnitt mit **9 von 10 möglichen Punkten** bewertet

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

- 21. Juni 2018, Frankfurt am Main
- 06. Dezember 2018, Frankfurt am Main
- 03. Juni 2019, Frankfurt am Main

Die Teilnahmegebühr beträgt pro Person und Termin **EUR 860** zzgl. MwSt.

Bei gleichzeitiger Anmeldung von mehreren Personen eines Unternehmens für denselben Termin, erhält die zweite und jede weitere Person eine **Ermäßigung in Höhe von 10%** des Seminarpreises.

1. PERSON

Anrede, Titel

Name, Vorname

Position, Abteilung

E-Mail

Firma

Straße, Nr.

Postfach

PLZ, Ort

Land

2. PERSON

Anrede, Titel

Name, Vorname

Position, Abteilung

E-Mail

RECHNUNGSDetails

Bestellreferenz

MwSt.-Nr.

Firma

Abteilung

Straße, Nr.

PLZ, Ort

Datum, Unterschrift

ANMELDUNG

Web www.exbase.de/ba
Telefon +49 (0)7531 922 82 33
E-Mail info@exbase.de
Post Exbase
Hindenburgstraße 2
78467 Konstanz
Deutschland

VERANSTALTUNGSORTE

Die Veranstaltungen finden in gehobenem Ambiente im Hotel statt. Weitere Details senden wir Ihnen rechtzeitig vor den jeweiligen Terminen per E-Mail.

TEILNAHMEBEDINGUNGEN

Geltungsbereich

Diese Teilnahmebedingungen regeln das Vertragsverhältnis zwischen dem Veranstalter und dem Teilnehmer. Der Teilnehmer erkennt mit seiner Anmeldung diese Teilnahmebedingungen an. Abweichende Allgemeine Geschäftsbedingungen des Teilnehmers haben keine Gültigkeit.

Teilnahmegebühr

Die Teilnahmegebühr beinhaltet die Teilnahme für eine Person. Sie versteht sich inklusive schriftlicher Unterlagen, Mittagessen und Tagungsgetränken zzgl. MwSt. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Diese ist direkt nach Erhalt, in jedem Fall vor Eintritt in die Veranstaltung, fällig.

Anmeldung

Die Anmeldung kann schriftlich via Internet, E-Mail, Fax oder per Post oder mündlich per Telefon erfolgen. Sie ist, vorbehaltlich gesetzlicher Widerrufsrechte, verbindlich. Jede Anmeldung erlangt erst durch schriftliche Bestätigung seitens des Veranstalters Gültigkeit. Die Veranstaltungsteilnahme setzt die vollständige Bezahlung der Teilnahmegebühr voraus.

Urheberrecht

Alle im Rahmen der Veranstaltungen ausgegebenen Unterlagen sowie anderweitig erworbene Artikel sind urheberrechtlich geschützt. Vervielfältigungen und anderweitige Nutzung sind schriftlich durch den Veranstalter zu genehmigen.

Rücktritt des Teilnehmers

Sollte der Teilnehmer an der Teilnahme verhindert sein, so ist er berechtigt jederzeit ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer zu benennen. Darüber hinaus ist eine vollständige Stornierung bis 30 Tage vor Beginn der Veranstaltung kostenlos möglich. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Bei späterem Rücktritt oder Nichterscheinen wird die gesamte Teilnahmegebühr fällig.

Programmänderungen und Absagen

Der Veranstalter behält sich vor, Änderungen am Inhalt des Programms sowie Ersatz und Weglassen der angekündigten Referenten vorzunehmen, wenn der Gesamtcharakter der Veranstaltung gewahrt bleibt. Muss eine Veranstaltung aus wichtigem Grund oder aufgrund höherer Gewalt (kriegerische Auseinandersetzungen, Unruhen, terroristische Bedrohungen, Naturkatastrophen, politische Beschränkungen, erhebliche Beeinflussung des Transportwesens usw.) abgesagt oder verschoben werden, so wird der Veranstalter die zu diesem Zeitpunkt angemeldeten Teilnehmer umgehend schriftlich oder mündlich benachrichtigen. Bereits eingegangene Zahlungen werden für eine zukünftige Veranstaltung gutgeschrieben oder bei einer Terminverschiebung auf den neuen Termin ausgestellt. Kosten seitens des Teilnehmers, die mit der Absage einer Veranstaltung verbunden sind (z. B. Reise- und Übernachtungskosten), werden nicht erstattet.

Haftung

Alle Veranstaltungen werden sorgfältig recherchiert, aufbereitet und durchgeführt. Sollte es dennoch zu Schadensfällen kommen, so übernimmt der Veranstalter keine Haftung für die Vollständigkeit und inhaltliche Richtigkeit in Bezug auf die Vortragsinhalte und die ausgegebenen Unterlagen.

Datenschutz

Überlassene persönliche Daten behandelt der Veranstalter in Übereinstimmung mit den geltenden datenschutzrechtlichen Bestimmungen. Sie werden zum Zwecke der Leistungserbringung elektronisch gespeichert. Einblick und Löschung der gespeicherten Daten kann jederzeit gefordert werden. Anfragen bitte per E-Mail an: info@exbase.de.