

Gegenwärtige Regulierung von Marktpreisrisiken

Kapitalunterlegung im Standardansatz und bei internen Modellen

www.exbase.de/grb

„Sie erhalten einen fundierten Überblick zur Regulierung von Marktpreisrisiken in Banken.“

Ihr Seminarleiter



Professor Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University

Themen der Veranstaltung

- Definition und Entwicklung von Marktrisiken
- Strategische und organisatorische Steuerung
- Quantitative und qualitative Regulierung nach MaRisk und CRD IV / CRR / RTS (inkl. Anforderungen nach Basel 2.5)
- Kapitalunterlegung im Standardansatz
- Kapitalunterlegung bei internen Modellen

Termine

24. März 2017, Frankfurt am Main

06. November 2017, Frankfurt am Main

SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Seminar erhalten Sie einen kompakten Überblick über Marktpreisrisiken und deren aktuelle Regulierung nach CRD IV / CRR: Sie erfahren, welche Risiken als Marktrisiken eingestuft und wie diese gesteuert werden. Anschließend erhalten Sie einen Überblick zu den gegenwärtigen regulatorischen Anforderungen an Marktrisiken und zur bankinternen Umsetzung hinsichtlich der Kapitalunterlegung im Standardansatz und bei internen Modellen.

AGENDA

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

09.00

Definition und Entwicklung von Marktrisiken

- Risikoinventur: Was sind Marktrisiken und was sind keine?
- Marktrisiken vor, während und nach der Krise
- Marktrisiken bei Nichthandelsbuchinstituten, Handelsbuchinstituten mit Standardansatz und Handelsbuchinstituten mit internen Modellen
- Besonderheiten der Marktrisiken wie schwankende Marktliquidität, instabile Diversifikation, systematische und idiosynkratische Risiken

10.30 Kaffeepause

10.45

Steuerungsrahmen

- Strategie, Prozesse und Verantwortlichkeiten
- Modelle und Informationssysteme
- Mitarbeiter und Anreizsysteme

Gegenwärtige Regulierung

- Historie der Marktpreisrisiko-Regulierung
- Qualitative Regulierung (MaRisk)
- Quantitative Regulierung (CRR)
- Überarbeitung der Marktpreisrisiken (Basel 2.5)

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.30

Kapitalunterlegung im Standardansatz

- Zinsinstrumente, Aktien und Währungen
- Rohstoffe und Optionen

15.30 Kaffeepause

15.45

Kapitalunterlegung mit internen Modellen

- Mindestanforderungen für die Zulassung
- Analytischer, historischer und simulativer Ansatz
- Verteilungsannahmen
- Value at Risk und Expected Shortfall

16.45

Zusammenfassung und Ausblick

17.00 Ende des Seminars

IHR SEMINARLEITER



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 auf internationalen Konferenzen und gibt Seminare zu aufsichtsrechtlichen Themen. Seine Projekterfahrung reicht im Marktrisiko vom Derivatepricing bis zum Setzen von Marktpreislimiten.

SEMINARUNTERLAGE UND NACHBETREUUNG

Sie erhalten als Seminarunterlage ein Handout, mit dem Sie die Inhalte des Seminars auch nach Besuch der Veranstaltung gut nachvollziehen können. Die Präsentation und Unterlagen von Prof. Dr. Schmaltz sind in englischer Sprache verfasst. Er referiert auf Deutsch.

Gerne steht Ihnen Prof. Dr. Schmaltz für drei Monate nach dem Seminar in gewissem Umfang für Fragen zu den Seminarinhalten zur Verfügung.

WER SOLLTE TEILNEHMEN?

Diese Veranstaltung richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus Banken und Sparkassen, Beratungsunternehmen und Aufsichtsbehörden mit den folgenden Schwerpunkten:

- Markt(preis)risiko
- Risikocontrolling
- Regulatorik
- Meldewesen
- Treasury
- Revision
- Aufsichtsrecht
- Handel

SEMINARREIHE: „REGULIERUNG DER MARKTPREISRISIKEN IN BANKEN“

Gegenwärtige Regulierung von Marktpreisrisiken

www.exbase.de/grm

Sensitivitätsbasierter Standardansatz

- Aufbau und Mechanik des Ansatzes
- Umsetzung der Kapitalunterlegung für Allgemeine Zinsrisiken, Credit Spreadrisiken, Aktien-, Fremdwährungs-, Rohstoff- und Ausfallrisiken
- Excel-Prototype für den Standardansatz
- Vergleichsrechnungen CRR- vs. neuer Standardansatz

www.exbase.de/sbs

Interne Modelle in Theorie und Praxis

- Überarbeitung des Handelsbuches
- Der neue interne Modelleansatz
- Berechnung der Kapitalunterlegung
- Prototype mit 450 Risikofaktoren in MS Excel
- Praktische Herausforderungen in der Umsetzung interner Modelle

www.exbase.de/imo

Dieses Seminar wurde im Schnitt mit 9,33 von 10 möglichen Punkten bewertet.

Anmeldung Seminare zur „Regulierung der Marktpreisrisiken in Banken“

Ja, hiermit melde ich mich für folgende/n Termin/e an:

- Gegenwärtige Regulierung am _____
- Sensitivitätsb. Standardansatz am _____
- Interne Modelle am _____

Die Teilnahmegebühr beträgt pro Person und Termin **EUR 950** zzgl. MwSt.

Gruppenrabatt: Melden sich mehr als zwei Personen eines Instituts oder Unternehmens für denselben Termin an, besucht die dritte und jede weitere Person das Seminar zum halben Seminarpreis.

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/fr
Telefon +49 7531 922 8233
E-Mail info@exbase.de
Post Exbase
Hindenburgstraße10
78467 Konstanz
Deutschland

VERANSTALTUNGSORTE

Die Veranstaltungen finden jeweils in zentraler Lage und in gehobenem Ambiente 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.

Exbase
Banking and Finance