

Interne Modelle in Theorie und Praxis

Der neue interne Modelleansatz & Herausforderungen bei der Umsetzung



www.exbase.de/imo

Diskutieren Sie mit unseren Experten Lösungsansätze für die Implementierung eines internen Modells.

Themen der Veranstaltung

- Überarbeitung des Handelsbuches
- Der neue interne Modelleansatz
- Vorgehen bei der Berechnung der Kapitalunterlegung
- Prototype eines einfachen internen Modells mit 450 Risikofaktoren in MS Excel
- Praktische Herausforderungen in der Umsetzung interner Modelle nach FRTB

Termine

- 29. März 2017, Frankfurt am Main
- 13. Juli 2017, Frankfurt am Main
- 08. November 2017, Frankfurt am Main

Ihre Referenten



Prof. Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University



Dr. Sebastian Irle
Bankenaufseher, Deutsche Bundesbank



Nadja Schuster
Senior Manager, d-fine GmbH

SEMINARBESCHREIBUNG

Das interne Modell ist komplexer als der sensitivitätsbasierte Standardansatz. Dennoch würde sich für viele Institut der Aufwand lohnen.

Im Seminar erfahren Sie, wie Sie nach den neuen regulatorischen Anforderungen ein internes Modell strategisch aufbauen. Wichtige Seminarinhalte werden anhand eines Prototypes mit 450 Risikofaktoren in Excel veranschaulicht. Zudem werden praktische Herausforderungen in der Umsetzung vorgestellt und diskutiert.

AGENDA

09.00

Überblick über die neue Handelsbuch-Abgrenzung

- Zielvorgaben des Baseler Ausschusses
- Die neue Handelsbuch-Definition
- Rahmenbedingungen für den Transfer zw. Bank- und Handelsbuch
- Interne Risiko-Transfers
- Hintergründe und Würdigung aus aufsichtlicher Sicht

Dr. Sebastian Irle, Deutsche Bundesbank

Einführung in den neuen internen Modelleansatz

- Zielvorgaben des Baseler Ausschusses
- Kernbestandteile des neuen internen Modelleansatzes
- Liquiditätsadjustierter Expected Shortfall als neues Risikomaß
- Beschränkte Anrechnung von Diversifikationseffekten
- Die neue Default Risk Charge (DRC)
- Nicht-modellierbare Risikofaktoren und ihre Kapitalunterlegung
- Kriterien für die Modellzulassung
- Hintergründe und Würdigung aus aufsichtlicher Sicht

Dr. Sebastian Irle, Deutsche Bundesbank

10.30 Kaffeepause

10.50

Prozess zur Berechnung der Kapitalunterlegung

- Bestimmung der Risikofaktoren
- Bestimmung der Stressperiode
- Kapitalunterlegung für modellierbare Risikofaktoren
 - Berechnung des Expected Shortfalls (ES), Basisperiode
 - Skalierung des ES mit Liquiditätshorizonten
 - Diversifizierter und additiver ES
- Kapitalunterlegung für nicht-modellierbare Faktoren
- Kapitalunterlegung für Ausfallrisiken
- Gesamtkapitalunterlegung

Prof. Dr. Christian Schmaltz, Aarhus University

12.20 Gemeinsames Mittagessen

13.45

Ein einfaches internes Modell in MS Excel (Prototype mit 450 Risikofaktoren)

- Daten und Verarbeitung
- Kapitalunterlegung (Spot), Kapitalunterlegung (über die Zeit)
- Modellzulassung und Backtesting

Prof. Dr. Christian Schmaltz, Aarhus University

FRTB-IM im Kontext

- Gegenpartierisiken
- Basel IV
- Standardansatz

Prof. Dr. Christian Schmaltz, Aarhus University

15.15 Kaffeepause

15.35

Praktische Herausforderungen - Interne Modelle nach FRTB

- Umstellung von VaR auf ES: Anforderungen an das Modell und die Daten
- Integration von Liquiditätshorizonten
- Kalibrierung und Aggregation
- Anforderungen an Berechnungsläufe
- Non-modellable Risk Factors: Identifikation, «Modellierung» etc.
- Default Risk Charge: Ausbau bestehender Modelle (IRC, Kreditportfoliomodell) und organisatorische Aspekte
- Backtesting und P&L Attribution (Aufbau von Zeitreihen)
- Auswirkungen auf die interne Steuerung
- Anmeldeprozess: Regulatorische Definition von Handelstischen, Umgang mit „partial use“ Modellen
- Wechselwirkungen mit dem Standardansatz

Nadja Schuster, d-fine GmbH

17.00 Ende des Seminars

IHRE REFERENTEN



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.

Als gefragter Referent spricht er regelmäßig auf Konferenzen, gibt Seminare zu aufsichtsrechtlichen Themen und erhielt einen Lehrauftrag an der Frankfurt School of Finance and Management.



Dr. Sebastian Irle ist Bankenprüfer in der Zentrale der Deutschen Bundesbank und Mitglied der Trading Book Group (TBG) des Baseler Ausschusses. Zuvor befasste er sich bei der Deutschen Bundesbank mit der Modellierung von Kreditrisiken und war als Unternehmensberater bei Simon-Kucher & Partners für internationale Finanzdienstleister tätig. Dr. Irle ist

Dozent an der Frankfurt School of Finance and Management, spricht regelmäßig auf Konferenzen und hat in führenden mathematischen Fachzeitschriften publiziert.



Nadja Schuster ist Senior Manager bei der d-fine GmbH. Seit mehr als 10 Jahren ist sie im Bereich Risikomanagement mit Schwerpunkt auf Marktrisikomethoden und -prozessen tätig. Sie befasst sich intensiv mit aktuellen und künftigen regulatorischen Anforderungen und hat bereits Auswirkungsstudien zur Fundamental Review of the Trading Book bei

mehreren Banken begleitet. Zuvor war Frau Schuster mehrere Jahre bei der DZ BANK im Marktrisikoccontrolling angestellt.

HINWEISE UND FEEDBACK ZUM SEMINAR

Diese Veranstaltung wurde im Schnitt mit **8,68 von 10 möglichen Punkten** bewertet. Als Seminarunterlage erhalten Sie ein Ringbuch mit den Präsentationen der Referenten. Die Unterlagen von Prof. Dr. Schmaltz sind in englischer Sprache verfasst. Er referiert auf Deutsch.

"Guter Einstieg in die Details der Internen Modelle unter dem FRTB."

Holger Fullriede, Revision Risikosteuerung/Verfahren, Nord/LB

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