

# Marktpreisrisiken nach FRTB

## Implementierung des alternativen Standardansatzes



[www.exbase.de/sbs](http://www.exbase.de/sbs)

Im Seminar erfahren Sie, wie Sie Marktpreisrisiken nach dem alternativen Standardansatz bewerten.

### Themen der Veranstaltung

- Der FRTB und seine Implementierung in der EU
- Aufbau und Mechanik des Ansatzes
- Umsetzung der Kapitalunterlegung für
  - Allgemeine Zinsrisiken
  - Fremdwährungsrisiken
  - Credit Spreadrisiken
  - Rohstoffrisiken
  - Aktienrisiken
  - Ausfallrisiken
- Vergleichsrechnungen CRR- vs. neuer Standardansatz

### Ihr Referent



**Dario Ruggiero**

Senior Manager der Aspect Advisory Group und Chartered Financial Analyst (CFA)

### Termine

15. April 2024, 09:00 - ca. 17:00 (Frankfurt am Main / Webinar)

27. und 30. September 2024, je 09:00 - ca. 12:30 (Webinar)

11. Dezember 2024, 09:00 - ca. 17:00 (Frankfurt am Main / Webinar)

## SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Seminar befassen Sie sich intensiv mit dem alternativen Standardansatz. Dabei werden die Neuerungen ausführlich besprochen und Lösungsansätze anhand von Excel-Beispielen erläutert.

Zudem werden Vergleichsrechnungen für Beispielpportfolien (gegenwärtige und zu-künftige Kapitalunterlegung) aufgestellt.

## AGENDA

09.00

### Der Fundamental Review und seine Implementierung in der EU

- Motivation des Fundamental Review of the Trading Book (FRTB)
- Bestandteile des FRTB mit Fokus auf den neuen Standardansatz: Aufbau und Mechanik
- Anstehende Arbeiten auf Baseler und europäischer Ebene zum Standardansatz
- Implementierung auf europäischer Ebene: Inhalt und voraussichtlicher Zeitplan

10.30 Kaffeepause

10.45

### Kapitalunterlegung, inkl. Excel-Beispiele für

- Allgemeine Zinsrisiken
- Credit Spreadrisiken
- Aktienrisiken

12.30 Gemeinsames Mittagessen

### Kapitalunterlegung, inkl. Excel-Beispiele für

- Fremdwährungs- und Rohstoffrisiken
- Ausfallrisiken

### Der universelle Datencontainer des SBA

15.30 Kaffeepause

15.45

### Vergleichsrechnungen: CRR- vs. neuer Standardansatz

- Wesentliche Faktoren für Abweichungen
- Struktur von regulatorisch teuren/preiswerten Portfolien
- Additivität und Subadditivität von Kapitalanforderungen

16.45

### Zusammenfassung und Ausblick

Ca. 17.00 Ende des Seminars

## HINWEIS ZUM SEMINAR

Bitte bringen Sie Ihren Laptop mit zur Veranstaltung, da wichtige Inhalte anhand von Excel-Beispielen erläutert werden. Falls Sie einen Übungsrechner benötigen, stellen wir Ihnen diesen gerne zur Verfügung.

## IHR REFERENT



**Dario Ruggiero** ist Senior Manager der Aspect Advisory Group. Zuvor war er viele Jahre als Senior Consultant für einen großen Meldewesenanbieter tätig. Sein Hauptaugenmerk lag dabei auf der Beratung und technischen Implementierung aufsichtsrechtlicher Neuerungen bei großen Retailbanken, Privatbanken und deutschen Landesbanken. Darüber hinaus verfügt er über sehr gute Kenntnisse der Meldesoftware BAIS.

**Je nach Verfügbarkeit von Herrn Ruggiero kann es sein, dass Prof. Dr. Schmalz ihn teilweise oder komplett vertritt.**



**Prof. Dr. Christian Schmalz** ist Gastprofessor für Finance an der EADA Business School und geschäftsführender Partner in der Aspect Advisory Group. In Lehre und Forschung befasst er sich intensiv mit der Steuerung und Regulierung von Banken. Als Berater betreut er viele europäische Banken im Risikomanagement und in der Umsetzung regulat. Anforderungen.

## SEMINARUNTERLAGEN

Als Unterlagen erhalten Sie die Präsentation als Ringbuch und PDF. Um nahe an den Originalpublikationen zu bleiben, ist die Präsentation in englischer Sprache verfasst. Das Seminar wird auf Deutsch durchgeführt.

## NACHBETREUUNG

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

## FEEDBACK

**„Das Seminar ist ein gut fundierter Einstieg in das Thema.“**

Alexandra Holzmann, Revision Gesamtbanksteuerung & Financial Markets, LBBW

**„Es wurde ein komplexer Sachverhalt umfassend und anschaulich erklärt.“**

Susanne Lefering, Management Consultant, Constructive Consulting GmbH

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

Holger Fullriede, Revision Risikosteuerung/Verfahren, Nord/LB

## INTERNE SCHULUNG

Bei Interesse an einem Online-Training oder Inhouse-Seminar freuen wir uns auf Ihre Anfrage an [info@exbase.de](mailto:info@exbase.de).

# Anmeldung „Marktpreisrisiken nach FRTB“

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

- 15. April 2024, 09:00 - ca. 17:00 Uhr, Frankfurt am Main / Webinar
- 27. und 30. September 2024, je 09:00 - ca. 12:30 Uhr, Webinar
- 11. Dezember 2024, 09:00 - ca. 17:00 Uhr, Frankfurt a.M. / Webinar

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

## Gratisticket

Melden sich drei Personen eines Instituts oder Unternehmens für den gleichen Termin an, besucht die dritte Person das Seminar gratis.

## 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/sbs](http://www.exbase.de/sbs)  
Telefon +49 (0)9194 7952057  
E-Mail [info@exbase.de](mailto:info@exbase.de)  
Post Exbase  
Hauptstr. 1  
91364 Unterleinleiter  
Deutschland

## VERANSTALTUNGSORTE UND -ZEITEN

Unsere Veranstaltungen finden meist in zentraler Lage in einem 4-Sterne-Hotel statt. Die Seminarzeiten variieren je nach Termin. Auch an unseren Präsenzterminen können Sie per Webinar teilnehmen.

## TEILNAHMEBEDINGUNGEN

### Geltungsbereich

Die Allgemeinen Geschäftsbedingungen regeln das Vertragsverhältnis zwischen Teilnehmer\*innen einer Veranstaltung und Exbase als Veranstalter. Teilnehmer\*innen erkennen mit ihrer Anmeldung diese Teilnahmebedingungen an.

### Teilnahmegebühr

Die Teilnahmegebühr beinhaltet die Teilnahme für eine Person. Sie versteht sich inklusive schriftlicher Unterlagen und im Falle einer Teilnahme vor Ort auch inkl. Mittagessen und Tagungsgetränken zzgl. MwSt. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Diese ist in jedem Fall vor Eintritt in die Veranstaltung fällig.

### Anmeldung

Die Anmeldung kann über das Anmeldeformular online, per E-Mail, per Post oder mündlich per Telefon erfolgen. Jede Anmeldung erlangt erst durch die schriftliche Bestätigung seitens des Veranstalters Gültigkeit und ist verbindlich.

### 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

Sollte die Teilnehmerin / der Teilnehmer an der Teilnahme verhindert sein, so ist sie / er berechtigt, ohne zusätzliche Kosten eine Ersatzteilnehmerin oder einen Ersatzteilnehmer zu benennen. Darüber hinaus ist eine kostenlose Stornierung bis dreißig Tage vor Beginn der Veranstaltung möglich. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Bei späterem Rücktritt oder Nichterscheinen wird die gesamte Teilnahmegebühr fällig. In diesem Fall können Sie Ihre Teilnahme zu einem Folgetermin kostenfrei nachholen, sofern dieser stattfindet.

### Programmänderungen und Absagen

Der Veranstalter behält sich vor, wenn notwendig Änderungen am Inhalt der Veranstaltung vorzunehmen und Referent\*innen auszutauschen, sofern der Gesamtcharakter der Veranstaltung gewahrt bleibt. Wird eine Veranstaltung aus wirtschaftlichen Gründen oder aufgrund von höherer Gewalt (kriegerische Auseinandersetzungen, Unruhen, terroristische Bedrohungen, Naturkatastrophen, politische Beschränkungen, erhebliche Beeinflussung des Transportwesens usw.) abgesagt, so ist Exbase verpflichtet, alle Teilnehmer\*innen umgehend zu benachrichtigen. In diesem Fall besteht Anspruch auf Rückerstattung der Veranstaltungsgebühr. Weitergehende Kosten wie bspw. Stornierungsgebühren von Teilnehmer\*innen werden von Exbase 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](mailto:info@exbase.de).

### Schlussbestimmungen

Der Vertrag unterliegt dem deutschen Recht.

**Exbase**  
Banking and Finance

Jetzt anmelden: [www.exbase.de/sbs](http://www.exbase.de/sbs)