

Marktpreisrisiken nach FRTB

Implementierung des alternativen Standardansatzes



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

Ihre Referenten



Professor Dr. Christian Schmaltz
EADA Business School



Dr. Sebastian Irle
Bankenaufseher, Deutsche Bundesbank und Mitglied der Trading Book Group, Baseler Ausschuss

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

(Holger Fullriede, Revision Risikosteuerung/Verfahren, Nord/LB)

Termine

26. Januar 2021, Frankfurt am Main

28. Juni 2021, Frankfurt am Main

06. Oktober 2021, Frankfurt am Main

SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Seminar befassen Sie sich intensiv mit dem sensitivitätsbasierten Standardansatz. Anhand von Excel-Beispielen werden anstehende Herausforderungen und Lösungsansätze vermittelt. Zudem werden Vergleichsrechnungen für Beispielportfolien (gegenwärtige und zukünftige Kapitalunterlegung) aufgestellt.

AGENDA

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

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
- Kritische Würdigung aus Aufsichtsperspektive

Dr. Sebastian Irle, Deutsche Bundesbank

10.30 Kaffeepause

10.50

Kapitalunterlegung, inkl. Excel-Beispiele für

- Allgemeine Zinsrisiken
- Credit Spreadrisiken
- Aktienrisiken

12.45 Gemeinsames Mittagessen

14.00

Kapitalunterlegung, inkl. Excel-Beispiele für

- Fremdwährungs- und Rohstoffrisiken
- Ausfallrisiken

Der universelle Datencontainer des SBA

15.30 Kaffeepause

15.50

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

17.00 Ende des Seminars

HINWEIS ZUM SEMINAR

Bitte bringen Sie Ihren Laptop mit zur Veranstaltung, da wichtige Inhalte des Seminars anhand von Excel-Beispielen erläutert und vertieft werden. Falls Sie einen Übungsrechner benötigen, geben Sie uns bitte Bescheid und wir stellen Ihnen diesen gerne zur Verfügung.

IHR SEMINARLEITER



Prof. Dr. Christian Schmaltz 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 regulatorischer Anforderungen. FTP-, FRTB-, LCR-Vorschau-, SA-CCR- und Early Warning-Modelle sind einige seiner Projektbeispiele der jüngeren Vergangenheit.



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.

SEMINARUNTERLAGEN UND NACHBETREUUNG

Sie erhalten als Seminarunterlage die Präsentationen als Ringbuch. Somit können Sie auch nach Besuch des Seminars die Inhalte gut nachvollziehen. Die Präsentation von Prof. Dr. Schmaltz ist 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.

Bei Interesse an einem Inhouse-Seminar schicken wir Ihnen gerne einen individuellen Seminarvorschlag. (info@exbase.de)

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

26. Januar 2021, Frankfurt am Main

06. Oktober 2021, Frankfurt am Main

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

Telefon +49 7531 922 8233

E-Mail info@exbase.de

Post Exbase

Hindenburgstraße 2

78467 Konstanz

Deutschland

VERANSTALTUNGSORTE

Das Seminar findet in gehobenem Ambiente in einem 4-Sterne-Hotel statt.

Weitere Details senden wir Ihnen vor dem jeweiligen Termin 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.