

Der SREP im SSM

Auswirkungen der Überprüfung der Säule 2 auf die Kapital- und Liquiditätskennzahlen der Säule 1

www.exbase.de/srep

Diskutieren Sie mit Prof. Dr. Schmaltz den SREP und erfahren Sie, wie Sie sich auf die neuen Anforderungen einstellen.

Ihr Seminarleiter



Professor Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University

Highlights aus dem Programm

- Anforderungen nach Kategorisierung der Institute
- Neue ganzheitliche Methode zur Kapital- und Liquiditätsbewertung (inkl. Funding)
- Schlüsselindikatoren für die Geschäftsmodellanalyse
- Bewertung der internen Governance und des Kontrollsystems
- Umsetzung in Deutschland: MaRisk+ oder MaSREP?

Termine

06. Dezember 2016, Frankfurt am Main

30. Mai 2017, Frankfurt am Main

SEMINARBESCHREIBUNG

Nach der EBA-Richtlinie SREP wird sich der aufsichtliche Überprüfungs- und Bewertungsprozess stark verändern. Im Sinne eines umfassenden Ansatzes zur Bewertung von Instituten werden künftig Schlüsselindikatoren, das Geschäftsmodell, die Governance sowie Kapital- und Liquiditätsrisiken verstärkt unter die Lupe genommen. Hierbei müssen alle Risikoarten als Teil einer ganzheitlichen Analyse betrachtet werden.

Im Seminar diskutieren Sie mit Prof. Schmaltz die anstehenden Neuregelungen durch den SREP und die daraus resultierenden Auswirkungen für kleinere und größere Institute. Der Fokus liegt auf der ganzheitlichen Beurteilung von Kapital- und Liquiditätsrisiken. Dabei werden Teilaspekte der Risikoarten aufgezeigt und deren Abhängigkeiten verdeutlicht.

AGENDA

09.00

Einordnung des SREP in den regulatorischen Beaufsichtigungsprozess

- Historie, aktueller Stand, Ausblick
- SREP im Rahmen von CRR/CRD IV
- MaRisk versus SREP
- Abhängigkeit zur Säule 1 (Minimumstandards)
- SREP und SSM-Banken bzw. Nicht-SSM-Banken
- Wie regelmäßig muss Ihr Institut den SREP durchlaufen?

Aufbau, Durchführung und Ergebnis des SREP

- Erläuterung der Inhalte des SREP
- Vorgehensweise bei der Durchführung
- Besprechung der Ergebnisse

10.30 Kaffeepause

10.45

Nachhaltigkeit des Geschäftsmodelles

- Definition von Geschäftsmodellen und Nachhaltigkeit
- Abgrenzung zum Geschäftsrisiko (Säule 2)

Kontroll- und Steuerungsprozess

- Anforderungen an Vorstand und Aufsichtsrat
- Risikokultur als Teil der Corporate Governance
- Adäquate Vergütungssysteme
- Three Lines of Defence Principle

Beurteilung der Kapitalrisiken

- Kreditrisiko
Abdeckung, Standardansatz, IRB-Modelle und Konzentrationsrisiken
- Marktpreisrisiken
Handelsbuch- und Nichthandelsbuchinstitute, Standardansatz, VAR- und IRM-Modelle
- Operationelle Risiken
Standardansatz und Modellbanken
- Zinsänderungsrisiken im Bankbuch
Bank- vs. Handelsbuch, Einkommens- vs. Marktwertschwankungen, Modellspektrum
- Einzelscores und Maßnahmen
- Gesamtbeurteilung der Kapitaladäquanz

12.15 Gemeinsame Mittagspause

13.15

Beurteilung der Liquiditätsrisiken

- Zahlungsunfähigkeitsrisiko
LCR vs. internes Modell, Abdeckung und Kalibrierung
- Refinanzierungsrisiko
NFSR vs. internes Modell, Abhängigkeiten mit EBA-Fundingplänen
- Einzelscores und Maßnahmen
- Gesamtbeurteilung der Liquiditätsadäquanz

14.45 Kaffeepause

15.00

Ergebnis des SREP

- Höhere Kapitalanforderungen unter Säule 1
- Höhere Liquiditätsanforderungen unter Säule 1
- Verbesserung der Modelle, Prozesse und Systeme

16.30 Zusammenfassung

17.00 Ende des Seminars

IHR SEMINARLEITER



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Assistant Professor für Finance an der Aarhus University und kooperierender Partner in der Aspect Advisory Group. 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.

WER SOLLTE TEILNEHMEN?

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

- Treasury
- Risikocontrolling
- Risikomanagement
- Meldewesen
- Aufsichtsrecht
- Interne Revision

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.

Gerne bieten wir Ihnen unsere Veranstaltungen auch als maßgeschneiderte Schulungen für Ihr Institut an.

Anmeldung „Der SREP im SSM“

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

06. Dezember 2016, Frankfurt am Main
 30. Mai 2017, Frankfurt am Main

Die Teilnahmegebühr beträgt pro Person und Termin **EUR 980** 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/srep
Telefon +49 (0)7531 922 82 33
E-Mail info@exbase.de
Post Exbase
Hindenburgstraße 10
78467 Konstanz
Deutschland

VERANSTALTUNGSORTE

Die Veranstaltungen finden 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