

Seminarprogramm

Aufsichtsrecht 2022

Regulatorische Updates und Lösungen für die Praxis

Inhouse - Seminare
auf Anfrage
(info@exbase.de)

www.exbase.de/banken

An allen Seminaren können Sie auch per Webinar teilnehmen.

Marktpreisrisiken nach FRTB

Implementierung des alternativen Standardansatzes

CRR III

Umsetzung der endgültigen Basel III - Reformen in der

CRR II und CRD V

Handlungsbedarf entsprechend der finalen Version

Praxisseminar & Workshops zur IVV

Pragmatische, rechtssichere und praxisbewährte Lösungen

IVV - Forum

Das Forum für den fachlichen Austausch

Praxisseminar SA - CCR

Derivatepositionen unter CRR II (COREP-Meldungen)

ICAAP - und ILAAP - Risikomodelle

Die Säule 2 im Fokus der Aufsicht

Intensivkurs zur LCR - Steuerung

Steuerung der LCR in Zeiten von ILAAP und NSFR

Unsere Referent*innen



Sonja Reinhard
Bundesbankdirektorin,
Deutsche Bundesbank



Uwe Krumei
Leiter HR Strategy und
Analytics, BayernLB



Jochim Rosenthal
RA und Legal Counsel,
Commerzbank



Prof. Dr. Christian Schmaltz
Professor für Finance, EADA
Business School



Dr. Sebastian Irlé
Bankenaufseher,
Deutsche Bundesbank



Dr. Christopher von Harbou
RA und Fachanwalt für
Arbeitsrecht



Rainer Voss
Vergütungsbeauftragter,
State Street Bank



Claudius Schokols
Leiter Risk Control Manage-
ment, BayernLB

Marktpreisrisiken nach FRTB

Im Seminar werden anstehende Herausforderungen und Lösungsansätze vermittelt. Zudem werden Vergleichsrechnungen für Beispielportfolien (gegenwärtige und zukünftige Kapitalunterlegung) aufgestellt.

Der Fundamental Review und seine Implementierung in der EU

- Motivation des Fundamental Review of the Trading Book
- 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 Zeitplan
- Kritische Würdigung aus Aufsichtsperspektive

Kapitalunterlegung, inkl. Excel-Beispiele für

- Allgemeine Zinsrisiken
- Credit Spreadrisiken
- Aktienrisiken
- Fremdwährungs- und Rohstoffrisiken
- Ausfallrisiken

Vergleichsrechnungen: CRR- vs. neuer Standardansatz

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

Zusammenfassung und Ausblick

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/sbs

„Gute Einführung in die Details des FRTB-SBA - mit Raum für Diskussion und Fragen.“ (H. Fullriede, Revision Risikosteuerung/Verfahren, Nord/LB)

„Es wurde ein komplexer Sachverhalt umfassend und anschaulich erklärt.“ (S. Lefering, Management Consultant, Constructive Consulting GmbH)

Termine

04. Mai 2022, Frankfurt am Main
19. Juli 2022, München
22. Sept. 2022, Stuttgart
25. Nov. 2022, Frankfurt am Main

An den Terminen in München und Stuttgart wird Herr Dr. Irle per Webinar zugeschaltet sein.

Referenten

Prof. Dr. Christian Schmaltz
Professor an der EADA Business School und Mitentwickler des BAIS-Moduls für den alternat. Standardansatz

Dr. Sebastian Irle
Bankenprüfer und Mitentwickler des alternativen Standardansatzes

CRR III

Im Seminar erhalten Sie eine gut aufbereitete Übersicht zum aktuellen Stand und den anstehenden Herausforderungen. Schwerpunkte bilden Empfehlungen für die Umsetzung des Standardansatzes für Kreditrisiken, Kreditrisikominderung und Verschuldungsquote.

Aktuelle Entwicklungen und Übersicht zur CRR III

- Post-Crisis-Agenda: Basel III & IV vs. CRR II & CRR III
- Aufsichtliche Schwerpunkte von BaFin und EZB in 2021 & 2022
- Aufsicht unter Covid 19
- Standardansatz für Kreditrisiken • Kreditrisikominderung
- Standardansatz Operationelle Risiken • CVA - Risiko
- Verschuldungsquote • Marktpreisrisiko • Output Floor
- Positionen EBA / EZB / EU COMM zu einzelnen Anforderungen
- Voraussichtliche Zeitachse für die Umsetzung in der EU

Standardansatz für Kreditrisiken

- Positionsklassen: Migrationen, Risikogewichtung, Anforderungen
- Banken • Immobilienkredite • Retailpositionen • Beteiligungen
- Unternehmen (inkl. KMU & Projektfinanzierung)
- Investmentfonds • Zentrale Gegenparteien
- Sorgfaltsprüfung bei auf externen Ratings basierenden Risikogewichten
- Währungsinduziertes Kreditrisiko

Kreditrisikominderung

- Anrechnungsfähige Sicherheiten (einfacher und umfassender Ansatz)
- SFT - Framework, inkl. Mindest-Haircuts • Währungshaircut
- Verrechnung mit Rahmenverträgen
- Durchschau bei Fondsicherheiten

Weitere Themen

- Operationelle Risiken: Welche Datengaps haben Sie?
- CVA: Zweck und Formel erklärt
- Verschuldungsquote: Warum eine 1-Seiten-Idee 25 Seiten Regulierung braucht
- Marktpreisrisiko: quo vadis?

Zusammenfassung und Ausblick

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/crr3

Termine

17. Februar 2022, Frankfurt am Main
25. August 2022, Hamburg
08. Dezember 2022, Frankfurt am Main

Referent

Prof. Dr. Christian Schmaltz
EADA Business School

Dr. Christian Schmaltz verfügt über Projekterfahrung aus der Schweiz, die Basel IV bereits umgesetzt haben.

CRR II und CRD V (2022 noch im Programm)

Im Seminar informiert Prof. Dr. Schmaltz über die Anforderungen durch die CRR II und CRD V und den daraus resultierenden Handlungsbedarf.

Themenüberblick

Waiver / Ausnahmen von Kapital- und Liquiditätsanforderungen | Standardansatz für Risikovolumina bei Gegenparteiisiken | Forderungen gegen zentrale Gegenparteien | Marktpreisrisiken (FRTB) | Großkredite | Verschuldungsquote | Meldewesen | Offenlegung | NSFR | IFRS 9 | SME Erleichterung bei Kapitalunterlegung | Projektfinanzierungen.

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/crr

„Prof. Dr. Schmaltz's Fachwissen und Kommunikationsfähigkeiten machen es einfach der Thematik zu folgen. Übersichtliche/informative Darstellung des Themas [...]“ (David Eichert, Meldewesen, Rentenbank)

„Empfehlenswert“ (Gregor Puttkammer, Senior Internal Auditor für Risikomodelle, Risikosteuerung und -verfahren, Nord/LB.)

Termine

16. Februar 2022, Frankfurt am Main
31. Mai 2022, Köln
22. November 2022, Frankfurt am Main

Referent

Prof. Dr. Christian Schmaltz
EADA Business School

Praxisseminar zur Institutsvergütungsverordnung

Im Seminar erfahren Sie, wie Sie die Anforderungen der IVV inklusive aller Neuerungen pragmatisch und rechtssicher umsetzen: **Tag 1** befasst sich mit allen Anforderungen, die für alle Institute gelten. An **Tag 2** werden zusätzliche Anforderungen besprochen, die nur für besonders regulierte Institute gelten. **(Beide Tage sind einzeln buchbar.)**

TAG 1

Gestaltung von Vergütungssystemen unter der InstitutsVergV

- Regulatorische Entwicklung und Motivation der Aufsicht
- Anstehende Neuerungen
- Geltungsbereich der IVV (Unternehmen, Vergütungen, Mitarbeiter)
- Fixe und variable Vergütung
- Auslands- und Funktionszulagen
- Verantwortung für die Vergütungssysteme

Die regulierte Vergütung: Strategie und Vorgaben

- Anforderungen an die Strategieausrichtung der Vergütungssysteme und -parameter
- Vorgaben zur Sicherstellung der Angemessenheit von Vergütung und Vergütungssystemen
- Garantiebonusverbot

Behandlung von Vergütungsthemen im Detail

- Abfindungen und Halteprämien
- Verhältnis von variabler und fixer Vergütung
- Bildung, Bemessung und Verteilung des Bonuspools
- Absicherungs- und Umgehungsverbot
- Vergütung der Mitarbeiter in den Kontrolleinheiten
- Vergütung der Geschäftsleitung

Dokumentation, Prüfung und weitere Pflichten

- Vergütungsgrundsätze in den Organisationsrichtlinien
- Erfüllung der jährlichen Angemessenheitsprüfung
- Interne Kommunikation und Hinwirkungspflicht
- Ermittlung der Risikoträger (ab 2021)
- Jährlicher Offenlegungsbericht: Aufbau und Inhalte
- Gruppensteuerung
- Prüfung und Kontrolle der Aufsicht

TAG 2

Ermittlung & Vergütung der Risikoträger in besonders regulierten Instituten

- Die neue Einteilung der Institute (ab 2021)
- Ermittlung der Risikoträger und Gruppen-Risikoträger
- Grundsätze für die variable Vergütung
- Ermittlung der variablen Vergütung
- Beurteilung der Zielerreichung und Dokumentation

Variable Vergütung für Risikoträger

- Zurückbehaltung variabler Vergütung und Malus
- Rückschauüberprüfung und nachträgliche Reduzierung der variablen Vergütung
- Ausscheiden des Risikoträgers

Vergütungsinstrumente, Clawback und Erstattung von Vorarbeitgeberboni

- Vergütung in Instrumenten
- Rückforderung bereits ausgezahlter variabler Vergütung (»Clawback«)
- Erstattung von Vorarbeitgeberboni
- Zusätzliche Leistungen zur Altersversorgung

Überprüfung der ordnungsgemäßen Umsetzung und Offenlegung

- Aufgaben und Rechte des Vergütungskontrollausschusses
- Die Rolle des/der Vergütungsbeauftragten
- Zusätzliche Offenlegungspflichten für bedeutende Institute

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/iv

„Sehr gut strukturiertes, praxisnahes Seminar, das die Inhalte anschaulich vermittelt. Absolute Empfehlung!“

(K. Heinrichs, Syndikusrechtsanwältin, Commerzbank AG)

„Die Inhalte wurden super rüber gebracht und auch die hybride Veranstaltung war sehr gut organisiert.“

(M. Erkens, Senior Personalreferent, Bank für Sozialwirtschaft AG (Online-Teilnahme))

„Umfassende Behandlung aller relevanten Themen, ein toller Austausch und eine lehrreiche Veranstaltung.“

(L. K. Wüpper, Rechtsanwältin | Employment Law, Deloitte Legal Rechtsanwaltsgesellschaft mbH)



Referenten

Uwe Krumei

Leiter HR Strategy und Analytics, BayernLB

Dr. Christopher von Harbou

Rechtsanwalt und Fachanwalt für Arbeitsrecht,
Mitautor des Praxiskommentars zur IVV

Termine

- 07./08. Dezember 2021, München
- 21./22. März 2022, Frankfurt am Main
- 19./20. Mai 2022, Köln
- 19./20. September 2022, Stuttgart
- 07./08. November 2022, Frankfurt am Main

3. Person
gratis

Workshop 1: Zielvereinbarungs- und Kontrollprozess

- Rechtliche Anforderungen bei Zielvereinbarung und Kontrolle
- Materielle Ziele und Zielkaskade
- Zielvereinbarungs- und Kontrollprozess BayernLB
- Qualitätssicherung und Erfahrungen aus einer Vor-Ort-Prüfung
- Kontrollfragen und Vermeidung von Gefälligkeitsgutachten
- Dokumentation und laufende Optimierung der Zielvereinbarungen

Termine (online, 09:00 - ca. 12:30)

14. März 2022 | 08. Juli 2022 | 14. November 2022

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/zv

Dieser Workshop wird ebenfalls von Uwe Krumei und Dr. Christopher von Harbou durchgeführt.

Workshop 2: Risikocontrolling für Vergütungsbeauftragte

- Anforderungen an die Funktion der Vergütungsbeauftragten
- Überblick über die Regulatorik: MaRisk, relevante Guidelines
- Risikocontrolling als Teil der Kontrollfunktion
- Risk Governance, Risikotaxonomie: Risikokultur, Risikoarten
- Risikobewertung, Reporting: Limitsysteme, Risikotragfähigkeit, ICAAP/ILAAP
- Risikonahme und Interessenskonflikte
- Potentielle Fehlanreize und Risikoaspekte in Vergütungssystemen
- Risikoaspekte bei variabler Vergütung: §7 Prüfung, Bonuspool, Limiteinhaltung

Termine (online, 09:00 - ca. 12:00)

07. März 2022 | 26. September 2022 | 02. November 2022

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/rc

Dieser Workshop wird von Claudius Schokols durchgeführt. Er ist stellvertretender Vergütungsbeauftragter und Leiter des Teams Risk Control Management der BayernLB.

IVV - Forum

Unser IVV - Forum bietet eine Plattform zum Praxisaustausch für Mitarbeiter*innen von „nicht bedeutenden“ und „bedeutenden“ Instituten. Durch die Aufteilung in 2 Foren können Sie durchweg an für Sie relevanten Fachvorträgen und Diskussionen teilnehmen.

Zielvereinbarungsprozess

- Qualitative und quantitative Ziele, Ableitung aus der Strategie
- Messbarkeit von Zielen
- Prozess der Zielvereinbarung und Zielerreichung
- Unterjährige Anpassung und Besonderheiten bei Kontrolleinheiten

Aufhebungsverträge und Abfindungen

- Rechtlicher Rahmen versus gängige Praxis
- Abfindungen als variable Vergütung
- Privilegierte Abfindungen (nach Formel, Sozialplanabfindung ...)
- Rahmenkonzept und Dokumentation
- Umgang mit Boni/Deferrals

Nach dem Mittagessen erfolgt eine Aufteilung in Forum A und Forum B

Forum A (bedeutende Institute i.S.d. KWG)

Ex-post-Risikoadjustierung (Backtesting, Clawback und Malus)

- Rückschauüberprüfung der urspr. Ermittlung variabler Vergütung
- Vergütung in Instrumenten • Rückforderung variabler Vergütung
- Dokumentationsanforderungen

Externe Überprüfung von Vergütungssystemen (EZB-Prüfung BayernLB)

- Rechtliche Grundlagen der Vor-Ort-Prüfung durch die EZB
- Vorbereitungsphase, Vor-Ort-Phase, Berichtsphase und Follow-up-Phase
- Institutsinterne Vorbereitung der Prüfung
- Ablauf und inhaltliche Schwerpunkte der Prüfung
- Behebung getroffener Feststellungen
- Organisationsrichtlinien und Dokumentation

Forum B (nicht bedeutende Institute i.S.d. KWG)

Überprüfung der Rechtskonformität der bisherigen Umsetzung

- Aufstellung der Vergütungsgrundsätze (mit Musterlösung)
- Kompetenzen, Verantwortung und Compliance

Praxisleitfaden zur Angemessenheitsprüfung nach § 12 IVV

- Wer ist zuständig? • Was ist genau zu prüfen?
- Maßnahmenplan bei festgestellten Mängeln

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/ivv

In Forum A referieren Rainer Voss und Uwe Krumej. In Forum B referiert Dr. Christopher von Harbou.

Referenten

Dr. Christopher von Harbou

Fachanwalt für Arbeitsrecht und Mitautor des Praxiskommentars zur IVV

Uwe Krumej

Leiter HR Strategy und Analytics, BayernLB

Jochim Rosenthal

Rechtsanwalt und Legal Counsel, Commerzbank

Rainer Voss

Vergütungsbeauftragter, State Street Bank

Termine in Frankfurt am Main

03. Dezember 2021 | 11. Mai 2022 | 09. Dezember 2022

Praxisseminar SA - CCR

Im Seminar erfahren Sie, wie Sie nach dem neuen Standardansatz Derivatepositionen regulatorisch bewerten und in COREP-Meldungen berücksichtigen.

SA-CCR

- Was sind Exposuremaße wie SA - CCR?
- Wofür wird SA - CCR verwendet?

Exposure-Ansätze in CRR I

- OEM • Marktbewertungsmethode
- Standard-Methode • Interne Modelle

Exposure-Ansätze in CRR II

- Modifizierte OEM • Reguläre SA - CCR
- Vereinfachte SA - CCR • Interne Modelle

Das SACCR - Modell

- Was ist die Idee hinter dem SACCR - Modell und seinen Bestandteilen?
- Anerkennung und Behandlung von Sicherheiten
- Illustrative EaD - Berechnung nach SA - CCR für Einzelpositionen

Umsetzungsempfehlungen und Beispiele aus der Praxis

- Komponenten und konzeptionelle Vergleiche: modifizierte OEM, vereinfachte SA - CCR und reguläre SA - CCR
- Mappen von Derivaten auf die Netting Sets
- Berechnung von modifizierter OEM, vereinfachter und regulärer SA - CCR für ein besichertes und ein unbesichertes Beispielportfolio (Excel)
- SA - CCR-Berechnungen am Beispiel eines Portfolios mit 30 Derivaten
- Besonderheiten der SA - CCR - Berechnung für LevRatio, Großkredite und Millionenkredite

Mapping von Transaktionen zu Risikoklassen und Hedgingsets

gemäß RTS 2019-02

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/saccr

„Technisch hat alles wunderbar geklappt und der Tag hat uns fachlich wirklich sehr weiter gebracht.“ (K.B., Business Analyst, iBS AG)

Termine

06. Mai 2022, Frankfurt am Main
23. November 2022, Frankfurt am Main

Referent

Prof. Dr. Christian Schmalztz
EADA Business School

ICAAP- und ILAAP - Risikomodelle

Nachdem die Säule 1 in den letzten 10 Jahren intensivst überarbeitet wurde (Basel III und IV), ist jetzt die Säule 2 (ICAAP, ILAAP, SREP) im Fokus der Aufsicht.



In diesem Seminar befassen Sie sich daher mit der Überarbeitung der ICAAP- und ILAAP-Risikomodelle und mit deren Zusammenspiel mit dem SREP.

ICAAP und ILAAP in der Gesamtschau

- Definition und Komponenten von ICAAP und ILAAP
- Was fällt nicht darunter?
- Zusammenspiel mit dem SREP
- Entwicklung der regulatorischen Anforderungen an ICAAP und ILAAP (MaRisk, EBA - Richtlinien, EZB-Erwartungen)
- Kapital- und Liquiditätsadäquanzaussage

Governance und Verzahnung mit der Risikosteuerung

- Anforderungen, Integrationsmöglichkeiten
- Dokumentation und regulatorisches Reporting im Rahmen des SREP

Fortführungs-/ Normative Perspektive versus Liquidations-/ Ökonomische Perspektive

- Methodische Anforderungen
- Gemeinsamkeiten und Unterschiede
- Szenariogeneration: Auswahl und Konsistenz
- Mögliche Vorgehensweisen bei der Umsetzung

ICAAP- und ILAAP-Risikoinventur

- Von der Geschäftsstrategie zu den materiellen Risiken
- Quantifizierungsanforderungen und Materialität
- Priorisierung und Standardisierung
- Implementierungsoptionen und -herausforderungen

ICAAP: Kapital und Kapitalbestandteile

- (Nicht) Anrechenbare Bestandteile
- Anpassungen und Zusammenspiel des Kapitals unter Säule 1, Fortführungs- und Liquidationsperspektive

ILAAP: Liquiditätspuffer und stabile Refinanzierung

- (Nicht) Anrechenbare Bestandteile
- Anpassungen und Zusammenspiel von Liquiditätspuffern unter Säule 1 (LCR), Fortführungs- und Liquidationsperspektive
- Zusammenspiel von Stabilem Funding unter Säule 1 (NSFR), Fortführungs- und Liquidationsperspektive

Risikomodelle

- Anforderungen und Implementierungsoptionen
- Anforderungen an die Validierung
- Zusammenspiel von statistischen Modellansätzen (EaR, VaR) und nicht-statistischen Modellansätzen (Stresstests, Szenarioanalyse)

Stress Testing (in Kombination mit EBA Guidelines)

- Welche Stresstests sind mit welcher Häufigkeit durchzuführen?
- Anforderungen und Design von Stresstests
- Inverse Stresstests

Zusammenfassung und Ausblick

Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/icaap

Termine

02. Dezember 2021, Frankfurt a.M.
18. Februar 2022, Frankfurt a.M.
30. Mai 2022, Köln
24. November 2022, Frankfurt a.M.

Referent

Prof. Dr. Christian Schmalztz
EADA Business School

Prof Dr. Christian Schmalztz ist in die Überarbeitung der ICAAP- und ILAAP Rahmenprogramme involviert.

Liquiditätsrisikomanagement in Banken

Für ein erfolgreiches Liquiditätsrisikomanagement muss verstanden werden, wie die LCR und NSFR auf verschiedene Produkte reagieren. In diesem Kurs erfahren Sie daher, wie man diese Kennzahlen effizient steuern und überwachen kann.

Aktueller Stand und europäische Umsetzung

- Die Liquiditätsquoten LCR und NSFR
- Einhaltung und Meldung der LCR und NSFR
- Zusätzliche Parameter der Liquiditätsüberwachung (ALMM)
- Aktuelle Anforderungen und Anwendungsfragen
- Liquiditätswaiver

Interaktion mit anderen regulatorischen Initiativen

- Margining und Aktivbelastungen
- LCR - Beobachtungskennzahlen
- MaRisk-Liquiditätsanforderungen
- SREP-Anforderungen

LCR - Mechanik

- Eingangsbeispiel zur Veranschaulichung in Excel
- Pufferbestandteile, Zu- und Abflüsse
- Caps und Auflösung von kurzfristigen besicherten Geschäften
- Wirkungsweise der Grundgeschäfte: Kauf und Verkauf von Wertpapieren, unbesicherte und besicherte Aufnahme/Anlage, Sicherheiten-swaps
- Zusammenspiel LCR vs. interne Liquiditätssteuerung

NSFR - Mechanik

- Eingangsbeispiel zur Veranschaulichung in Excel
- Steuerung der NSFR und Abgrenzung zur LCR
- NSFR und Fundingpläne

Statische und dynamische LCR-Steuerung

- Kosten der LCR - Einhaltung
- Senkung der Pufferkosten
- LCR - Strategien
- Kostentoptimale Einhaltung der LCR
- LCR - Vorschau
- Warum eine LCR - Vorschau aufsichtsseitig gewünscht ist
- Vorschau für die nächsten 12 Meldestichtage

Verursachungsgerechte Allokation der LCR - Kosten

- LCR -kompatible Reserve und ihre Kosten
- Allokation von Pufferkosten
- MaRisk- vs. LCR -Pufferkosten
- Makro- vs. Mikroallokation

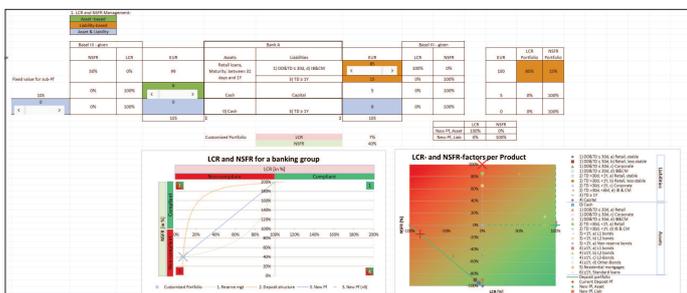
Ausführliche Broschüre: www.exbase.de/lcr

„Sehr gute Vermittlung der LCR mit sehr hohem praktischen Bezug.“

(E. Rabe, Regulatory Analytics & Policies, Commerzbank AG)

„Sehr guter Überblick über LCR + NSFR und Treasury relevante Themen.“

(M. Graf, Treasury-Liquiditätsmanagement, DekaBank Deutsche Girozentrale.)



Termine

- 05. Mai 2022, Frankfurt a.M.
- 18. Juli 2022, München
- 21. Sept. 2022, Köln
- 07. Dez. 2022, Frankfurt a.M.

Referenten

Prof. Dr. Christian Schmaltz

EADA Business School

Sonja Reinhard

Bundesbankdirektorin, Deutsche Bundesbank und Mitglied der EBA Subgroup on Liquidity

An den Terminen in München und Köln wird Frau Sonja Reinhard per Webinar zugeschaltet sein.

3. Person gratis

WEITERE INFORMATIONEN

Unsere Seminare richten sich an Fach- und Führungskräfte aus Banken, Sparkassen und anderen Instituten, insb. aus den Bereichen Personal, Revision, Treasury, Risikocontrolling, Aufsichtsrecht und Meldewesen.

Alle Seminare (bis auf die Workshops) werden als Hybrid-Veranstaltung angeboten. Das heißt, Sie können vor Ort oder per Webinar teilnehmen.

Die Seminare beginnen um **09.00 Uhr** und enden gegen **17.00 Uhr**. Empfang ist ab 08.30 Uhr.

Zum Mittagessen erwartet Sie ein Drei-Gang-Menü oder ein umfangreiches Buffet. In den Kaffeepausen können Sie sich mit Kaffee und Tee sowie je nach Hotel mit Fingerfood, Kuchen und Obst stärken.

Als Seminarunterlagen erhalten Sie die Präsentationen der Referenten als Ringbuch sowie je nach Kurs auch Excel-Beispiele bzw. weitere Unterlagen. Die Präsentationen von Prof. Dr. Schmaltz und Dr. Irle sind in englischer Sprache verfasst. Referiert wird stets auf Deutsch.



Ausführliche Informationen zu diesen und weiteren Kursen sowie alle aktuellen Termine können Sie unserer Website entnehmen: www.exbase.de/banken

Bei Interesse an einem Inhouse - Seminar oder einem Online - Training schicken wir Ihnen gerne einen maßgeschneiderten Seminarvorschlag.

UNSERE REFERENT*INNEN



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Professor für Finance an der EADA Business School. 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. Immer nah an der Praxis berät er jährlich zahlreiche Finanzinstitute auf Konferenzen und Seminaren.



Sonja Reinhard ist Bundesbankdirektorin in der Abteilung Bankenaufsichtsrecht und internationale Bankenaufsicht. Schwerpunkte ihrer Tätigkeit bilden Grundsatzfragen zur internationalen und europäischen Liquiditätsregulierung. Frau Reinhard hat am Entwurf der europäischen Liquiditätsregeln mitgearbeitet, ist als Vertreterin der Deutschen Bundesbank in der EBA Subgroup on Liquidity an der Erarbeitung Technischer Standards beteiligt und als Mitglied des EBA Q&A Networks für Auslegungsfragen zuständig.



Uwe Krumei ist Leiter der Abteilung HR Strategy und Analytics der BayernLB. Ein Arbeitsschwerpunkt der Abteilung ist die regulatorikkonforme Ausgestaltung, Weiterentwicklung und rechtssichere Umsetzung der Vergütungssysteme. Uwe Krumei befasst sich intensiv mit der Entwicklung der Vergütungsstrategie und der Gruppensteuerung im BayernLB-Konzern. Zudem betreute er eine umfassende EZB-Prüfung zur Umsetzung der InstitutsVergV.



Dr. Christopher von Harbou ist Rechtsanwalt und Fachanwalt für Arbeitsrecht. Von 2011 bis 2017 betreute er die Umsetzung der InstitutsVergV bei der BayernLB. 2013 begleitete er federführend die Sonderprüfung der Vergütungssysteme. Über besondere Expertise verfügt Christopher von Harbou in der Gestaltung von Vergütungssystemen. Zudem ist er Mitautor des Praxis-kommentars zur InstitutsVergV.



Dr. Sebastian Irle ist Bankenprüfer in der Zentrale der Deutschen Bundesbank und Mitglied der Trading Book Group des Baseler Ausschusses. Zuvor war als Unternehmensberater bei Simon-Kucher & Partners für internationale Finanzdienstleister tätig. Dr. Irle ist zudem Dozent an der Frankfurt School of Finance and Management.



Jochim Rosenthal ist Rechtsanwalt und Legal Counsel im Bereich Arbeitsrecht der Rechtsabteilung der Commerzbank AG. Sein Aufgabengebiet umfasst insbesondere die Beratung zu den Vergütungssystemen für Vorstand und Mitarbeiter der Commerzbank. Seit 2011 betreut er die Umsetzung der InstitutsVergV bei der Commerzbank und berät den Aufsichtsrat und die Personalabteilung in allen Fragen zu den Vergütungssystemen.



Foto folgt

Rainer Voss ist Rechtsanwalt und Vergütungsbeauftragter der State Street Bank International GmbH. In dieser Position kümmert er sich insb. um die Anpassung der globalen State Street Vergütungssysteme an die regulatorischen Vorgaben für bedeutende Institute. Zuvor war Rainer Voss in verschiedenen Banken als Jurist tätig und leitete für 10 Jahre die Rechtsabteilung der State Street Bank International GmbH.



Claudius Schokols ist stellv. Vergütungsbeauftragter und leitet das Risk Control Management der BayernLB. Er verfügt über langjährige Erfahrung im Risikocontrolling und Treasury. Mit seinem Team kümmert er sich um eine regulatorisch konforme Risk Governance und um Aufgaben der Risikoidentifikation, -überwachung und -steuerung. Ferner befasst er sich mit den Anforderungen an die gruppenweite Ausgestaltung des ICAAPs und ILAAPs.

VERANSTALTUNGORT

Die Veranstaltungen finden in einem meist in zentraler Lage gelegenen 4-Sterne-Hotel statt.



WEGE ZUR ANMELDUNG

Web www.exbase.de/banken
Telefon +49 (0)9194 795 20 57
E-Mail info@exbase.de
Post Exbase | Hauptstr. 1 | D-91364 Unterleinleiter

Hiermit melde ich mich für folgende Veranstaltung(en) an:

„Marktpreisrisiken nach FRTB“ am _____

„CRR III“ am _____

„CRR II und CRD V“ am _____

„Praxisseminar zur InstitutsVergV“ am _____

„Zielvereinbarungs- und Kontrollprozess“ am _____

„Risikocontrolling für Vergütungsbeauftragte“ am _____

„IVV-Forum“ am _____

„Praxisseminar SA-CCR“ am _____

„ICAAP- und ILAAP-Risikomodelle“ am _____

„Liquiditätsrisikomanagement in Banken“ am _____

Bitte informieren Sie sich über die Teilnahmegebühr auf der jeweiligen Veranstaltungsseite auf www.exbase.de/banken. Diese liegt zwischen **750 und 950 Euro zzgl. MwSt.** pro Seminartag. Unsere halbtägigen Workshops sind günstiger.

Falls Sie **per Webinar** teilnehmen möchten, vermerken Sie dies bitte im Anmeldeformular im Feld „Anmerkungen“.

1. PERSON

Anrede, Titel _____

Name, Vorname _____

Position, Abteilung _____

E-Mail _____

Firma _____

Straße, Nr. _____

PLZ, Ort _____

Land _____

2. PERSON

Anrede, Titel _____

Name, Vorname _____

Position, Abteilung _____

E-Mail _____

RECHNUNGSDetails

Firma _____

Abteilung _____

Straße, Nr. _____

PLZ, Ort _____

Anmerkungen

Datum, Unterschrift _____

Unsere AGB finden Sie unter:
www.exbase.de/agg

Exbase
Banking and Finance