

Seminarreihe

Regulierung der Marktpreisrisiken in Banken

Alle Seminare sind
einzeln buchbar

www.exbase.de/fr

Seminar 1: Gegenwärtige Regulierung

- Steuerungsrahmen und gegenwärtige Regulierung
- Kapitalunterlegung im Standardansatz
- Kapitalunterlegung bei internen Modellen

Seminar 2: Sensitivitätsbasierter Standardansatz

- Excel-Beispiele für die Kapitalunterlegung von allen relevanten Marktrisiken
- Vergleichsrechnungen CRR- vs. neuer Standardansatz

Seminar 3: Interne Modelle in Theorie und Praxis

- Der neue interne Modelleansatz
- Excel-Beispiel eines einfachen internen Modells
- Praktische Herausforderungen in der Umsetzung interner Modelle nach FRTB

Termine in Frankfurt am Main

14. bis 16. März 2016

08. bis 10. Juni 2016

Referenten



Prof. Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University



Dr. Sebastian Irle
Bankenaufseher, Deutsche Bundesbank



Nadja Schuster
Senior Manager, d-fine GmbH

Seminar 1: Gegenwärtige Regulierung

In diesem Seminar erhalten Sie einen kompakten Überblick über die aktuelle Regulierung der Marktpreisrisiken nach CRD IV / CRR.

Referent: Prof. Dr. Christian Schmaltz

Agenda

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

08.50

Definition und Entwicklung von Marktrisiken

- Risikoinventur: Was sind Marktrisiken und was sind keine?
- Marktrisiken vor, während und nach der Krise
- Marktrisiken bei Nichthandelsbuchinstituten, Handelsbuchinstituten mit Standardansatz und Handelsbuchinstituten mit internen Modellen
- Besonderheiten der Marktrisiken wie schwankende Marktliquidität, instabile Diversifikation, systematische und idiosynkratische Risiken

10.30 Kaffeepause

10.50

Steuerungsrahmen

- Strategie, Prozesse und Verantwortlichkeiten
- Modelle und Informationssysteme
- Mitarbeiter und Anreizsysteme

Gegenwärtige Regulierung

- Historie der Marktpreisrisiko-Regulierung
- Qualitative Regulierung (MaRisk)
- Quantitative Regulierung (CRR)
- Überarbeitung der Marktpreisrisiken (Basel 2.5)

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.30

Kapitalunterlegung im Standardansatz

- Zinsinstrumente, Aktien und Währungen
- Rohstoffe und Optionen

15.45 Kaffeepause

16.05

Kapitalunterlegung mit internen Modellen

- Mindestanforderungen für die Zulassung
- Analytischer, historischer und simulativer Ansatz
- Verteilungsannahmen
- Value at Risk und Expected Shortfall

17.00 Ende des Seminars

Seminar 2: Sensitivitätsbasierter Standardansatz

In diesem Seminar befassen Sie sich intensiv mit dem künftigen sensitivitätsbasierten Standardansatz. Anhand von Excel-Beispielen werden anstehende Herausforderungen und Lösungsansätze vermittelt. Zudem werden Vergleichsrechnungen für Beispielpportfolien (gegenwärtige und zukünftige Kapitalunterlegung) aufgestellt. Kenntnisse der gegenwärtigen Kapitalunterlegung (siehe Seminar 1) werden vorausgesetzt.

Referent: Prof. Dr. Christian Schmaltz

Agenda

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

08.50

Der sensitivitätsbasierte Standardansatz

- Aufbau und Mechanik des Ansatzes
- Abgrenzung und Synergien (Sensitivitäten) mit dem internen Modell
- Gewichtungen, Netting und Diversifikation
- Einführung der Aggregationsformeln anhand von Beispielen

10.30 Kaffeepause

10.50

Kapitalunterlegung (inkl. Excelbeispiele) für:

- Allgemeine Zinsrisiken
- Credit Spreadrisiken
- Aktienrisiken

12.45 Gemeinsames Mittagessen

14.00

Kapitalunterlegung (inkl. Excelbeispiele) 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

17.00 Ende des Seminars

HINWEIS ZU DIESEM SEMINAR

Alle Teilnehmenden werden gebeten, ihren eigenen Laptop mitzubringen. Dieser sollte mit MS Excel ausgestattet sein, um die kursbegleitenden Excel-Übungen ausführen zu können.

Seminar 3: Interne Modelle in Theorie und Praxis

In diesem Seminar liegt der Fokus auf der zukünftigen Regulierung der internen Marktpreisrisikomodelle. Nach aktuellem Kenntnisstand stellen Sie sich den Fragen: Welche regulatorischen Anforderungen erwarten Sie? Wie setzen Sie diese in Ihrem Institut um?

Agenda

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

08.50

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 Irlé, 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 und 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

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

Prof. Dr. Christian Schmaltz, Aarhus University

FRTB-IM im Kontext

- FRTB-Standardansatz
- Offenlegung
- Andere Risikoarten im Handelsbuch: Gegenparteiisiken
- Ähnliche Risiken im Bankbuch: Zins- und Spreadrisiken
- Basel IV
- Kapitalunterlegung vs. Besicherung

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», Pflegeprozesse
- Default Risk Charge: Ausbau bestehender Modelle (IRC, Kreditportfolio modell) 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

ZIELGRUPPE

Unser Seminarangebot richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus Banken und Sparkassen sowie anderen Finanzdienstleistungsinstituten mit folgenden Schwerpunkten:

- Markt(preis)risiko
- Meldewesen
- Aufsichtsrecht
- Treasury
- Handel
- Risikocontrolling
- Risikomanagement
- Regulatorik
- Revision

SEMINARUNTERLAGE

Sie erhalten ein Handout, mit dem Sie die Inhalte des Seminars auch nach Besuch der Veranstaltung gut nachvollziehen können. Um nahe an den Originalpublikationen zu bleiben, sind die Unterlagen von Prof. Dr. Schmaltz in englischer Sprache verfasst. Er referiert in Deutsch.

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 Marktrisikokontrolling angestellt.

INHOUSE-SEMINARE ZU AUFSICHTSRECHTLICHEN THEMEN

Gerne erstellen wir Ihnen einen Seminarvorschlag für ein maßgeschneidertes Inhouse-Seminar. Detaillierte Seminarvorschläge finden Sie unter: www.exbase.de/banken

Ja, hiermit melde ich mich für folgende/n Termin/e an:

im Zeitraum vom 14. bis 16. März 2016, Frankfurt am Main

Seminar 1 Seminar 2 Seminar 3

im Zeitraum vom 08. bis 10. Juni 2016, Frankfurt am Main

Seminar 1 Seminar 2 Seminar 3

Die Teilnahmegebühr beträgt pro Person und Termin für **Seminar 1 EUR 790** zzgl. MwSt., für **Seminar 2** und **Seminar 3** jeweils **EUR 940** zzgl. MwSt.

Meldet sich eine Person zu mehreren Seminaren an, erhält sie für den Besuch des zweiten und dritten Seminars jeweils einen **Rabatt von EUR 100**.

Bei gleichzeitiger Anmeldung von mehreren Personen eines Unternehmens für ein Seminar zum gleichen Termin erhält die zweite und jede weitere Person eine **Ermäßigung in Höhe von EUR 100**.

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 (0)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.