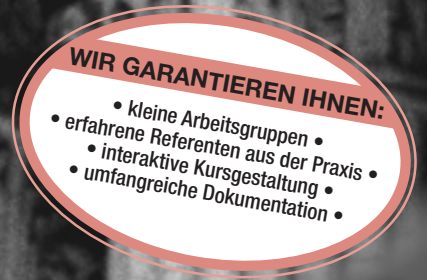




International Faculty of Finance

»Seminar war breit angelegt, Inhalte wurden interessant und gut verständlich dargelegt.«

Margitta Weis,
Deutsche Postbank AG, Bonn



Basel II Spezial

Säule 1 und Säule 2

Ihr Expertenteam

- **Dr. Alexander Suyter**,
Risk & Management
Consultancy, München
- **Markus Linss**,
Hypo Real Estate,
München

Termine und Kursorte

- **05. – 06. Februar 2007**
Offenbach bei Frankfurt/Main
- **10. – 11. September 2007**
Frankfurt/Main

Seminarschwerpunkte

- **Säule 2 bei Basel II: So sehen die Prinzipien der aufsichtsrechtlichen Überwachung aus!**
- **Übergreifende Risikosteuerung im Rahmen der Säule 2: Risikotragfähigkeit, Risikostrategie, etc.**
- **Szenarien für die Eigenkapitalanforderung**
- **Säule 1 bei Basel II: Erfahren Sie aktuelle Neuerungen zum Doppelausfalleffekt, Counterparty Credit Risk in Basel II und Neuerungen im Handelsbuch von 2005!**
- **Mit Praxisbericht der Hypo Real Estate zur Umsetzung der Säule 2!**

! Informieren Sie sich umfassend über die Neuerungen im Handelsbuch, die Sie zukünftig bei der Umsetzung der Basel II-Vorschriften beachten müssen!



Tel.: 06196 - 585-460



anmeldung@iir.de



ZUM SEMINARINHALT

Nachdem im Sommer 2004 die Rahmenvereinbarung über die neue Eigenkapitalempfehlung für Kreditinstitute verabschiedet wurde, hat die EU-Kommission **2005 mit neuen Vorschriften zum Handelsbuch nachgelegt**. Diese Vorschriften umfassen u.a. Änderungen bei der Ermittlung des sog. Counterparty Credit Risk, Anpassungen im spezifischen Risiko, Änderungen bei der Behandlung von Settlement Risiken sowie Berücksichtigung des Doppelausfalleffektes und sollen bis zum Juli 2005 in das endgültige Basel-Papier aufgenommen und verabschiedet werden.

Erfahren Sie in unserem Seminar, welche Änderungen und Neuerungen durch das Baseler Papier auf Sie zukommen! Durch die **zahlreichen Fallbeispiele**, die Sie zusammen mit unserem Referenten durchführen, wird Ihnen die spätere Umsetzung in Ihrem Institut vereinfacht. Unser **Praxisbericht** der Berlin-Hannoverschen Hypothekenbank AG erläutert Ihnen anschaulich, wie das bankinterne Risikomanagement im Rahmen der Säule 2 umgesetzt wird.

FÜR WEN IST DER KURS KONZIPIERT?

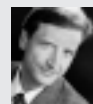
Dieses Seminar richtet sich an Fach- und Führungskräfte von Kredit- und Finanzinstituten aus den Bereichen **Meldewesen, Bankenaufsicht, Revision, (Risiko-)Controlling, Risikomanagement, Treasury und Recht**.

Es werden **Grundkenntnisse von Basel II vorausgesetzt**. Zur optimalen Vorbereitung empfehlen wir Ihnen den vorherigen Besuch unseres Seminars „Basel II-Workshop“.



IHR REFERENTENTEAM

Dr. Alexander Suyter



ist Inhaber der Risk & Management Consultancy in München (www.AS-RIMC.de). Schwerpunkte seiner Tätigkeit liegen im Risikocontrolling, in der Unternehmenssteuerung, Basel II, Rating, MaK, MaH, Risikoüberwachung, Reporting und Meldewesen, insbesondere in der Vernetzung und Umsetzung der einzelnen Fragestellungen. Er ist zudem Referent auf Tagungen und Seminaren und publiziert als Autor einschlägige Beiträge in Fachzeitschriften und Kommentaren der Wirtschafts- und Finanzpresse. Vorher war Dr. Suyter verantwortlich u.a. als Projektleiter Rating- und Kreditrisikosteuerung, zuletzt als Leiter der Verfahrensumsetzung im Bereich Produktkonzeption von Handelsprodukten sowie als Abteilungsleiter für das Kreditrisiko-Controlling in einer deutschen Großbank.

Markus Linss

leitet den Bereich Risikocontrolling der Hypo Real Estate. Group Risk Control (GRC) überwacht die Ausfall-, Markt-, Liquiditäts-, und operationellen Risiken innerhalb der Gruppe. Parallel dazu besitzt der Bereich die konzernweite Methodenkompetenz für die verwandten Pricing- und Bewertungsmodelle sowie die Verantwortung für die Umsetzung der neuen Eigenkapitalverordnung nach Basel II. Daneben verantwortet GRC die Entwicklung und Umsetzung eines risikoadjustierten Steuerungskonzeptes innerhalb der Gruppe. Zuvor leitete Herr Linss den Bereich Economic Capital / Gesamtbanksteuerung innerhalb des Konzernstabes Risikocontrolling der Commerzbank. Schwerpunkte seiner damaligen Tätigkeit waren die Weiterentwicklung des qualitativen und quantitativen Risk-/Return Ansatzes, die Aggregation der verschiedenen Risikoarten über interne Modelle und die Compliance mit internen und externen Anforderungen der Risikoberichterstattung. Zusätzlich leitete er zu dieser Zeit das konzernweite MaRisk und Asset-/Liability Projekt. Insgesamt verfügt Herr Linss über eine operative und projektbezogene Berufserfahrung im Risikocontrolling von 11 Jahren.

TAG 1

→ Einleitung: Aufbau Basel II

→ Säule 2 in Basel II: Supervisory Review Prozess

- Prinzipien des Supervisory Review Prozess
- Baseler Prinzipien (Kreditrisiko, Zinsänderungsrisiko)
- Umsetzung durch MaRisk: Mindestanforderungen für das Risikomanagement
 - Aufbau der MaRisk
 - Module der MaRisk
 - Zeitplan
 - Gesetzliche Basis

→ Risikosteuerung im Rahmen der Säule 2

- Das Risikomanagement in der Bankorganisation
- Risikotragfähigkeit
- Limite und Stress-Szenarien
- Einflussgrößen der internen Verlustverteilung
- Konzentrationsrisiken, Diversifikation und Granularität

Fallbeispiele: Stress-Szenarien für die Risikotragfähigkeit

- Risikoadjustierte Barwertberechnung

Fallbeispiel: Risikoadjustiertes Pricing

- Risikostrategie

Fallbeispiel: Teilstrategie Kreditrisikostrategie

- Risikoreport: Berichtswege

→ Basel II: Säule 1

- Risikobewertungsansätze
- Anforderungen an die Verfahren und Risikoparameter
- Berechnung der Eigenkapitalquote gemäß Basel II in Säule 1
- Credit Risk Mitigation in Basel II

Fallbeispiele: Ermittlung der Risikogewichte und Risikokurven verschiedener Assetklassen bei unterschiedlichen Sicherheiten im IRB-Ansatz

- Trennung Expected und Unexpected Loss in Basel II
- Shortfall/Excess
- Risikokurven
- Skalierung von Basel II
- Zeitplan

Seminarzeit von 9.30 bis 17.30 Uhr

TAG 2

→ EU-Umsetzung von Basel II

- Basis der Umsetzung
- Besonderheiten
- BaFin, Bundesbank: Leitlinien zur Basel II-Umsetzung



→ Counterparty Credit Risk in Basel II

- Bewertungsansätze
 - Current Exposure, Potential Future Exposure
 - Neuer aufsichtlicher Standardansatz
 - Struktur
 - Beispiel
- Interne Modelle (Expected Exposure, VaR)
 - Definitionen
 - Operationale Anforderungen
 - Einbettung der Modelle im Rahmen der verwendeten Ansätzen im Anlagebuch
 - Aufsichtliche Multiplikatoren
 - Laufzeitanpassung
 - Beispiele

→ Erweiterung Credit Risk Mitigation

- Substitutionsansatz
- Double default Ansatz
 - Operationale Anforderungen
 - Ableitung und Parametrisierung
- Fallbeispiele und Vergleichsrechnungen

→ Neuerungen im Handelsbuch

→ Fazit

→ Praxisbericht der Hypo Real Estate:

Umsetzung des Prozesses der angemessenen Eigenkapitalausstattung im Rahmen einer risikobasierten Gesamtbanksteuerung

- Qualitative und quantitative Anforderungen an einen Prozess der angemessenen Eigenkapitalausstattung (ICAAP)
- Behandlung von Markt-, Kredit-, Geschäfts- und Operationellen Risiken
 - Risikohandbuch als wesentlicher Baustein zur Erfüllung von Basel II Säule 2
 - Aggregation und Berichterstattung
- Integration des Risikomanagements in die Gesamtbanksteuerung
 - Banksteuerung nach regulatorischem Kapital und Konsequenzen
 - Risikotragfähigkeitsrechnung: Ableitung von Risikodeckungsmassen und Verlustobergrenzen
 - Etablierung einer Risikostrategie für das Management der Marktpreis-, Kredit- und operationellen Risiken im Rahmen der Risikotragfähigkeit als Engpassfaktor
- Erfolgsfaktoren und Herausforderungen bei der Umsetzung von Risk Adjusted Performance Measurement in die Gesamtbanksteuerung

Seminarzeit von 9.00 bis 17.00 Uhr



DATEN ZUM SEMINAR

05. – 06. Februar 2007, Offenbach bei Frankfurt/Main
10. – 11. September 2007, Frankfurt/Main

TEILNAHMEGEBÜHR

€ 1.995,- p.P. zzgl. gesetzl. MwSt

ERGÄNZENDE SEMINARE

Von Basel II zur Solv

07. – 08. Februar 2007, Frankfurt/Main, www.iir.de/basel

Mindestanforderungen an das Risikomanagement

07. – 08. Dezember 2006, Frankfurt/Main;
25. – 26. Juni 2007, Frankfurt/Main, www.iir.de/marisk

§ 44 KWG – Einblicke in die Prüfungspraxis

20. – 21. November 2006, Sulzbach/Ts. bei Frankfurt/Main;
02. – 03. Mai 2007, Frankfurt/Main, www.iir.de/bankenaufsicht

ÜBER UNS



KONGRESSE & SEMINARE

Mit derzeit über 200 Mitarbeitern, 14 spezialisierten Geschäftsbereichen und rund 2000 Veranstaltungen jährlich ist IIR Deutschland einer der führenden Kongress- und Seminar-Anbieter.

Mehr als 500.000 Kunden setzen seit nahezu 20 Jahren auf unsere Qualität.

Über aktuellste Inhalte, unbedingten Praxisbezug, kompetenteste Referenten und Trainer, perfekte Organisation und optimalen Service vermitteln wir unseren Teilnehmern einen wirklichen und nachhaltigen Mehrwert.

Konsequente Kunden- und Marktorientierung – dafür steht IIR Deutschland.



Die „International Faculty of Finance“ ist spezialisiert auf Seminare und Kongresse zu Finanzthemen. Praxisnahe Schulung steht ebenso im Vordergrund wie umfassende Information über aktuelle Trends und Strategien.



IFF NEWSLETTER

NEU!

Unter www.iir.de können Sie sich direkt auf der Startseite für unseren **Newsletter zum Thema Banken/Finanzen** registrieren.



INHOUSE TRAINING

Profitieren Sie von einer firmeninternen Schulung zu diesem Thema

Individuell

Wir passen das Seminar ihren Bedürfnissen und Vorkenntnissen an. Ort und Termin der Schulung wählen Sie.

Praxisorientiert

Unsere Referenten sind qualifizierte, methodisch-didaktisch erfahrene Experten auf ihrem Gebiet.

Effizient

Der Zeitaufwand für eine umfassende Schulung Ihrer Mitarbeiter lässt sich auf ein Minimum begrenzen.

Für weitere Informationen und Angebote rufen Sie mich bitte an:

Katja Oel, Tel.: 06196 - 585-1154



Bitte ausfüllen und faxen!
06196 - 585-456

3 Gründe für den Besuch des Seminars

1. Sie erhalten einen kompakten Überblick über die neuen Vorschriften zum Handelsbuch.
2. Zahlreiche Fallbeispiele erleichtern die Umsetzung in die Praxis.
3. Ideales Seminar für alle, die bereits Grundkenntnisse von Basel II haben!

Informationen zur Anmeldung

Post: International Faculty of Finance (IFF)
Ein Geschäftsbereich der
IIR Deutschland GmbH
Postfach 1050
65836 Sulzbach/Taunus

Telefon: 06196 - 585-460
Fax: 06196 - 585-456
E-Mail: anmeldung@iir.de
Internet: www.iir.de

Für Ihre inhaltlichen Fragen:

Gabriele Richter, Teamleiterin Produktentwicklung,
Tel.: 06196 - 585-1162

Für Ihre organisatorischen Fragen:

Customer Service Team, Tel.: 06196 - 585-460

Stimmt Ihre Adresse?

Bitte geben Sie uns Ihre Änderungen durch:
Tel.: 06196 - 585-434
Fax: 06196 - 585-400

Informationen zum Seminar

Teilnahmegebühr

Die Teilnahmegebühr beträgt € 1.995,- (zzgl. gesetzl. MwSt.). Der Preis versteht sich pro Person und beinhaltet Dokumentation, Teilnahmebestätigung, Mittagessen und Erfrischungen. Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung die Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Der Rechnungsbetrag ist fällig – ohne Abzug rein netto – mit Erhalt der Rechnung, spätestens jedoch 14 Tage vor Veranstaltungsbeginn.

Qualitätsgarantie

Stellen Sie am ersten Seminartag bis 12.00 Uhr vormittags fest, dass der gebuchte Kurs nicht das Richtige für Sie ist, so können Sie den Seminarbesuch abbrechen und statt dessen einen anderen Kurs besuchen.

Veranstaltungsort/Zimmerreservierung

Für unsere Kursteilnehmer steht in den unten genannten Hotels ein begrenztes Kontingent zu besonderen Konditionen zur Verfügung. Setzen Sie sich bitte rechtzeitig direkt mit den Hotels in Verbindung.

05.–06. Februar 2007

Arabella Sheraton

Am Büsing Palais

Berliner Str. 111

63065 Offenbach/Frankfurt

10.–11. September 2007

Hotel auf Anfrage

Frankfurt/Main

Stornierung/Rücktritt

Bei Stornierung der Anmeldung bis 30 Tage vor Veranstaltungstermin erheben wir keine Stornierungsgebühr. Bei Stornierung im Zeitraum von 30 Tagen bis 14 Tage vor Veranstaltungstermin erheben wir eine Bearbeitungsgebühr von 50% der Teilnahmegebühr. Bei späteren Absagen wird die gesamte Teilnahmegebühr berechnet, sofern nicht von Ihnen im Einzelfall der Nachweis einer abweichenden Schadens- oder Aufwandshöhe erbracht wird. Die Stornoerklärung bedarf der Schriftform. Eine Umbuchung (Benennung Ersatzteilnehmer/andere IIR-Veranstaltung) ist zu jedem Zeitpunkt möglich. In diesem Fall wird eine Gebühr in Höhe von € 50,- (zzgl. gesetzl. MwSt.) fällig. Diese Gebühren entfallen, wenn die Umbuchung aus Gründen erfolgt, die die IIR Deutschland GmbH zu vertreten hat.

Datenschutz

Ihre Daten werden für die interne Weiterverarbeitung und eigene Werbezwecke von uns unter strikter Einhaltung des BDSG gespeichert. Ggfs. geben wir Adressen an Unternehmen weiter, deren Angebot für Sie hinsichtlich Inhalt, Qualität und Service interessant sein könnte. Wenn Sie die Speicherung oder Weitergabe Ihrer Daten bzw. unsere Werbung an Ihre Adresse nicht wünschen, bitte Nachricht an IIR Deutschland GmbH, Postfach 1050, 65836 Sulzbach, Tel. 06196-585-0, E-Mail datenschutz@iir.de und Ihre Daten werden gesperrt (weitere Infos unter www.iir.de/datenschutz.html).

Änderungen vorbehalten



ich möchte teilnehmen:

05. – 06. Februar 2007, Offenbach bei Frankfurt/Main

10. – 11. September 2007, Frankfurt/Main

M4723

M4884

Bitte geben Sie bei Ihrer Anmeldung unbedingt den rechts genannten Mailcode an!

1. Teilnehmer

Name Vorname

Funktion Abteilung/Hauspostcode

Telefon Fax

Bitte senden Sie mir zukünftig Informationen per E-Mail/Fax:

E-Mail/Fax Unterschrift

2. Teilnehmer

Name Vorname

Funktion Abteilung/Hauspostcode

Telefon Fax

Bitte senden Sie mir zukünftig Informationen per E-Mail/Fax:

E-Mail/Fax Unterschrift

genehmigende/r Vorgesetzte/r

Name Vorname

Funktion

Firmenname

Postfach

PLZ/Ort

Tel. Fax

Bitte ausfüllen, falls die Rechnungsanschrift von der Kundenanschrift abweicht:

Rechnungsstelle/Abteilung Name

Postfach PLZ/Ort



verbindl. Unterschrift Datum

FBP 17/IW



Ihre Anmeldung faxen Sie bitte an: 06196 - 585-456



www.iir.de