

»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 Experte

→ **Dr. Alexander Suyter**,
Risk & Management
Consultancy, München

Termine und Kursorte

→ **22. – 23. August 2006**
Frankfurt/Main

→ **05. – 06. Februar 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 einer großen deutschen Bank 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!



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 REFERENT

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.



VERANSTALTUNGSÜBERSICHT PER E-MAIL

Einmal im Monat werden Sie über die aktuellen Veranstaltungen aus dem Bereich **Banken** oder dem Bereich **Controlling** informiert.

Senden Sie uns hierzu bitte eine E-Mail mit dem Text **subscribe banken** oder **subscribe controlling** an: listserv@iir.de

Wir versichern Ihnen, Ihre E-Mail-Adresse vertraulich zu behandeln.

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 Kreditrisikostategie

- Risikoreport: Berichtswege

Praxisbericht einer großen deutschen Bank: Gesamtisikomanagement in der Bankpraxis – in Vorbereitung auf Säule 2

- Definition der Bausteine
- Zusammenspiel der Module
- Genutzte Verfahren und Prozesse
- Besonderheiten in der Praxis
- Datenbasis und -verfügbarkeit
- Erfahrungen mit der Aufsicht

Seminarzeit von 9.30 bis 17.30 Uhr

WIR GARANTIEREN IHNEN:

- kleine Arbeitsgruppen
- erfahrene Referenten aus der Praxis
- interaktive Kursgestaltung
- umfangreiche Dokumentation

TAG 2

→ 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

→ 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

Seminarzeit von 9.00 bis 17.00 Uhr



DATEN ZUM SEMINAR

22. – 23. August 2006, Frankfurt/Main
05. – 06. Februar 2007, Frankfurt/Main

TEILNAHMEGEBÜHR

1.995,- EUR p.P. zzgl. MwSt.

GRUPPENRABATTE

Nutzen Sie unser attraktives Rabattsystem! Besuchen mehrere Teilnehmer aus dem gleichen Unternehmen den selben Seminartermin, gewähren wir bei gemeinsamer Anmeldung folgende Rabatte:



Der zweite Teilnehmer erhält: **10% Rabatt**



Der dritte Teilnehmer erhält: **20% Rabatt**



Der vierte Teilnehmer erhält: **30% Rabatt**

Diese Rabatte können nur gewährt werden, sofern kein anderer Rabatt/Vorteilspreis genutzt wird.



ERGÄNZENDE SEMINARE

Basel II-Workshop

23. – 24. Oktober 2006, Sulzbach bei Frankfurt/Main
www.iir.de/basel

Mindestanforderungen an das Risikomanagement

06. – 07. Juli 2006, Offenbach bei Frankfurt/Main
www.iir.de/marisk

§ 44 KWG – Einblicke in die Prüfungspraxis

20. – 21. November 2006, Sulzbach bei Frankfurt/Main
www.iir.de/bankenaufsicht



INHOUSE TRAINING 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.

Preisvorteil

Durch die gleichzeitige Schulung mehrerer Mitarbeiter sparen Sie bis zu 30%.

Für weitere Informationen und Angebote rufen Sie mich bitte an:

Katja Oel, Tel.: 06196 - 585-1154



ÜBER UNS

Die International Faculty of Finance – IFF – ein Geschäftsbereich des Institute for International Research – hat sich auf Seminare aus folgenden Bereichen spezialisiert: Zahlungsverkehr, Kapitalmarkt und Derivate, Risikomanagement, Rechnungslegung, Kreditgeschäft/Finanzierung, Corporate Finance, Controlling und Strategie, Trading und Analyse, Asset Management und Vermögensverwaltung, Basel II und Aufsichtsrecht sowie Compliance.

Wir wenden uns an Fach- und Führungskräfte in Banken, Versicherungen, Handel, Industrie und bieten aktuelle Informationen in komprimierter Form. Unsere Referenten werden nach umfangreichen praktischen Erfahrungen sowie hervorragenden methodisch-didaktischen Fähigkeiten ausgewählt.

Gemeinsam mit unserem Advisory Board, das sich aus renommierten Finanzexperten von Banken und Unternehmen sowie Wissenschaftlern zusammensetzt, garantieren wir Ihnen Qualität und Innovation der angebotenen Seminare.



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

Per Post: International Faculty of Finance (IFF)
Eine Division der IIR Deutschland GmbH
Postfach 1050
65836 Sulzbach/Taunus

Per Telefon: 06196 - 585-460
Per Fax: 06196 - 585-456
Per E-Mail: anmeldung@iir.de
Per 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. MwSt.). Die Preise verstehen sich pro Person und beinhalten Dokumentation, 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.

22.-23. August 2006 **05.-06. Februar 2007**

Le Meridien Parkhotel Hotel auf Anfrage
Wiesenhüttenplatz 28-38 Frankfurt/Main
60329 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. 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

Ja,

ich möchte teilnehmen:

22. – 23. August 2006, Frankfurt/Main
 05. – 06. Februar 2007, Frankfurt/Main

M4626
M4723

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 26