

Novelle der MaRisk

- MaRisk-Novelle: Internationale Entwicklungen und Zielsetzung der Bankenaufsicht
- Risikomanagement auf Gruppenebene
- Risikokonzentration
- Einbindung des Aufsichtsorgans
- Vergütungssysteme
- Stresstesting/Liquiditätsrisiken

Stresstesting

- Aufsichtsrechtliche Anforderungen
- Einbindung von Stresstests in die Gesamtbanksteuerung
- Stresstest für Liquiditätsrisiken
- Stresstest für Kreditrisiken
- Stresstest für Marktrisiken

Machen Sie sich fit für die verschärften Anforderungen!

Ihre Experten



Johann Kalkbrenner, Referatsleiter Banken und Finanzaufsicht, Deutsche Bundesbank, Hauptverwaltung München

Jochen Peppel, Senior Manager, Oliver Wyman GmbH

Dr. Gerhard Schröck, Partner, Finance & Risk, Oliver Wyman GmbH

Markus Streck, Leiter Risk Methodology Trading, Commerzbank AG

Dr. Alexander Suyter, Inhaber, Risk & Management Consultancy

Ralf Weidenhammer, Freier Berater und Vorstandsmitglied des A.C.I.

„Risikomanagement unter verschärften Bedingungen“

(all4finance, 10.07.09)

Die Novelle der MaRisk sowie der verstärkte Fokus auf das Thema Stresstesting sind die vielleicht wichtigsten Antworten der Aufsicht auf die Turbulenzen im Bankensektor. Das Risikomanagement steht nun unter besonderer Beobachtung, zahlreiche Anforderungen wurden verschärft.

Informieren Sie sich jetzt!

Am **ersten Tag** stehen die aktuellen Änderungen der MaRisk im Mittelpunkt. Dabei werden sowohl neue Anforderungen an das Risikomanagement auf Gruppenebene und Vergütungsfragen als auch Fragen der Risikokonzentration sowie neue Regelungen der Einzelrisiken beleuchtet. In diesem Kontext werden Fragen der Datenhistorie und Messbarkeit ebenso diskutiert wie die praktische Umsetzung.

Am **zweiten, separat buchbaren Tag** stehen Stresstests im Mittelpunkt. Aufsichtsrechtliche Rahmenbedingungen, Stresstest-Methoden sowie die konkrete Umsetzung bei den Einzelrisiken werden diskutiert. Daneben wird aufgezeigt, wie Stresstests in die Gesamtbanksteuerung eingebunden werden können.

Dieses Training ist konzipiert für:

Führungs- und Fachkräfte aus Banken, Sparkassen, Volks- und Raiffeisenbanken aus den Bereichen (Risiko-) Controlling und Risikomanagement, Gesamtbanksteuerung, Meldewesen, Revision und Grundsatzfragen. Daneben sprechen wir Verbandsvertreter, Wirtschafts-, Steuer- und Unternehmensberater an.

Novelle der MaRisk Sämtliche Änderungen und ihre Umsetzung

Montag, 18. Januar 2010

Donnerstag, 25. Februar 2010

9.00 – 9.30

Empfang mit Kaffee und Tee, Ausgabe der Seminarunterlagen

9.30 – 11.00

Novellierung der MaRisk – Intention und wesentliche Inhalte

- MaRisk als Daueraufgabe – Wesentliche Anstöße für die Weiterentwicklung
- Ausgewählte Schwerpunkte der Novellierung
 - Notwendigkeit und Ausgestaltung von Stresstests
 - Überarbeitung der Regelungen zum Liquiditätsrisiko
 - Präzisierung beim Thema „Risikokonzentrationen“
 - Angemessene Einbindung des Aufsichtsorgans
 - Vergütungssysteme im Kontext der MaRisk

- Next Steps – Ausblick
 - Überlegungen zur Umsetzung bei den Instituten
 - Prüfungspraxis

Johann Kalkbrenner, Referatsleiter Banken und Finanzaufsicht, Deutsche Bundesbank, Hauptverwaltung München

11.00 – 11.30 Pause mit Kaffee und Tee

11.30 – 12.30

Lehren aus der Krise

- Marktentwicklungen
- Rettungspakete und Wettbewerb

12.30 – 13.30 Gemeinsames Mittagessen

13.30 – 15.00

Risikomanagement auf Gruppenebene

- Gesetzliche Basis
- Anwendungsbereich
- Gruppenweite Strategien
- Risikobericht
- Revision
- Risikotragfähigkeit

Dr. Alexander Suyter, Inhaber, Risk & Management Consultancy

15.00 – 15.30 Pause mit Kaffee und Tee

15.30 – 17.30

Marktpreisrisiken/Zinsrisiken

- Handelsbuch versus Anlagebuch
- Fristentransformation - Aller Laster Anfang?
- Transfer Pricing im Treasury
- Embedded Options

Liquiditätsrisiken

- Vom operativen zum strukturellen Liquiditätsmanagement
- Liquiditätssicherung, Planung und Umsetzung
- Stresstest pur und seine Auswirkungen
- Liquiditätspuffer im Widerspruch zwischen Sicherheit und Kosten
- Jenseits der gesetzlichen Vorgaben, too big and too complex to fail? Das Missverständnis der Marktteilnehmer

Ralf Weidenhammer, Freier Berater und Vorstandsmitglied des A.C.I.

17.30 Ende des ersten Trainingstages und gemeinsamer Umtrunk

3 gute Gründe für dieses Training:

1. Sie erhalten einen komprimierten Einblick in alle Änderungen der MaRisk-Novelle.
2. Sie erfahren direkt von der Aufsicht, auf welche Verschärfungen Sie sich einstellen müssen.
3. Experten aus der Praxis erläutern Ihnen die Knackpunkte bei der konkreten Umsetzung.

– **Separat buchbar** –

Stresstesting Anforderungen, Methoden, Praxis

Dienstag, 19. Januar 2010

Freitag, 26. Februar 2010

8.30 – 9.00

Empfang mit Kaffee und Tee
Ausgabe der Seminarunterlagen

9.00 – 10.30

Einführung Stresstesting

- Anwendungsgebiete und Zielsetzungen
- Systematik, Einsatzmöglichkeiten und Anforderungen
- Aufsichtsrechtliche Anforderungen (Basel II, SolvV, MaRisk)
- Aktuelle Entwicklungen

10.30 – 11.00 **Pause mit Kaffee und Tee**

11.00 – 13.00

Ökonomisch-basierte Stresstests für einzelne Risikoarten

- Stresstest für Kreditrisiken
 - Konzeption
 - Identifikation von Stress-Szenarien
 - Integration in das Portfolio-Management
- Stresstest für Marktrisiken
 - Konzeption
 - Stresstest und VaR
 - Identifikation von Risikofaktoren
- Stresstest für Liquiditäts- und Funding-Risiken
 - Ableitung von Stresstests
 - Anwendung im Liquiditäts- und Funding-Management

13.00 – 14.00 **Gemeinsames Mittagessen**

14.00 – 15.00

Einbindung von Stresstests in die Gesamtbanksteuerung

- Integration von Stresstests und Szenarioanalysen über Risikoarten hinweg
- Fallbeispiel

Dr. Gerhard Schröck, Partner, Finance & Risk und
Jochen Peppel, Senior Manager, Oliver Wyman GmbH

15.00 – 15.30 **Pause mit Kaffee und Tee**

15.30 – 17.00

Praktische Umsetzung von Stresstesting in Banken

- Stresstesting als effektives Tool zum Risikomanagement
- Bedeutung der aktuellen regulatorischen Anforderungen an Stresstesting für die Praxis

- Bausteine für erfolgreiches Stresstesting in der Praxis
 - Marktrisiken
 - Kontrahentenrisiken
 - Liquiditätsrisiken
 - Kreditrisiken
 - Integrierte Stresstesting-Ansätze in der Praxis
 - Statistische Ansätze für Stresstesting in der Praxis
 - Ausblick
- Markus Streck**, Leiter Risk Methodology Trading, Commerzbank AG

17.00 **Ende des zweiten Trainingstages**

3 gute Gründe für dieses Training:

1. Sie erhalten einen komprimierten Einblick in die aufsichtsrechtlichen Anforderungen an Stresstests.
2. Sie erfahren, wie Sie Stresstests für verschiedene Risiken sowie auf Gesamtbankebene durchführen.
3. Experten aus der Praxis erläutern Ihnen die Knackpunkte bei der konkreten Umsetzung.

Info-Telefon:

+49 (0)2 11.96 86 – 34 61

Inhalt und Konzeption

Carola Bergmann

Senior-Konferenz-Managerin Banken

E-Mail: carola.bergmann@informa.com

Organisation

Anne Zenz

Konferenz-Koordinatorin

E-Mail: anne.zenz@informa.com



www.handelsblatt.com/training

[Kenn-Nummer] 37VM

Handelsblatt Financial Training

Novelle der MaRisk/ Stresstesting.

- Separat buchbar -

18.-19. Januar 2010, Frankfurt am Main

25.-26. Februar 2010, München

Ja, ich nehme/wir nehmen teil. Preis zzgl. MwSt. pro Person.

	in Frankfurt am Main [P1200353]	in München [P1200354]
MaRisk und Stresstesting	<input type="checkbox"/> 18. - 19. Januar 2010, Preis €1.999 [M012]	<input type="checkbox"/> 25. - 26. Februar 2010, Preis €1.999 [M012]
MaRisk	<input type="checkbox"/> 18. Januar 2010, Preis €1.299 [M100]	<input type="checkbox"/> 25. Februar 2010, Preis €1.299 [M100]
Stresstesting	<input type="checkbox"/> 19. Januar 2010, Preis €1.299 [M200]	<input type="checkbox"/> 26. Februar 2010, Preis €1.299 [M200]

Ich möchte als Dankeschön für meine Teilnahme **das Handelsblatt kostenlos für zwei Monate erhalten.**

Bitte korrigieren Sie meine Adresse wie angegeben. Wir nehmen Ihre **Adressänderung** auch gerne telefonisch auf: +49(0)2 11.96 86-3333.

Name (1)
Position
Abteilung
E-Mail

Die Informa Deutschland SE darf mich über verschiedenste Angebote von sich, Konzern- und Partnerunternehmen wie folgt zu Werbezwecken informieren:

Zusendung **per E-Mail:** Ja Nein **per Fax:** Ja Nein

Name (2)
Position
Abteilung
E-Mail

Die Informa Deutschland SE darf mich über verschiedenste Angebote von sich, Konzern- und Partnerunternehmen wie folgt zu Werbezwecken informieren:

Zusendung **per E-Mail:** Ja Nein **per Fax:** Ja Nein

Firma
Ansprechpartner im Sekretariat
Anschrift
Telefon
Telefax

Beschäftigtenzahl an Ihrem Standort

bis 20 21-50 51-100 101-250
 251-500 501-1000 1001-5000 über 5000

Rechnung an

Name
Abteilung
Anschrift

Datum
Unterschrift

So melden Sie sich an:

telefonisch +49 (0)2 11.96 86-34 61 [Anne Zenz]
Zentrale +49 (0)2 11.96 86-30 00
per Telefax +49 (0)2 11.96 86-40 40
E-Mail anmeldhb@euroforum.com
schriftlich EUROFORUM, Informa Deutschland SE
 Postfach 11 12 34, 40512 Düsseldorf

Termine und Orte 18. - 19. Januar 2010, **Novotel Frankfurt City**
 Lise-Meitner-Straße 2, 60486 Frankfurt am Main,
 Telefon: +49 (0)69.7 93 03-0

25. - 26. Februar 2010, **Hotel Excelsior**
 Schützenstraße 11, 80335 München
 Telefon: +49 (0)89.5 51 37-0

Wir über uns.

Handelsblatt Veranstaltungen vermitteln Ihnen in hochkarätigen Konferenzen und Seminaren wichtige Wirtschaftsinformationen zu aktuellen Themen. Wir bieten damit Führungskräften aus Wirtschaft und Industrie Foren für Know-how-Transfer und Meinungsaustausch. Mit der Planung und Organisation der Veranstaltungen haben wir EUROFORUM, einen Geschäftsbereich der Informa Deutschland SE, beauftragt.

www.handelsblatt.com/training

Teilnahmebedingungen.

Der Teilnahmebetrag für diese Veranstaltung inklusive Tagungsunterlagen, Mittagessen und Pausengetränken pro Person zzgl. MwSt. ist nach Erhalt der Rechnung fällig. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Bestätigung. Die Stornierung (nur schriftlich) ist bis 14 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenlos möglich, danach wird die Hälfte des Teilnahmebetrages erhoben. Bei Nichterscheinen oder Stornierung am Veranstaltungstag wird der gesamte Teilnahmebetrag fällig. Gerne akzeptieren wir ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer. Programmänderungen aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

Datenschutzinformation.

Das Handelsblatt und EUROFORUM, ein Geschäftsbereich der Informa Deutschland SE, verwenden die im Rahmen der Bestellung und Nutzung unseres Angebotes erhobenen Daten in den geltenden rechtlichen Grenzen zum Zweck der Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen postalisch Informationen über weitere Angebote von uns sowie unseren Partner- oder Konzernunternehmen zukommen zu lassen. Wenn Sie unser Kunde sind, informieren wir Sie außerdem in den geltenden rechtlichen Grenzen per E-Mail über unsere Angebote, die den vorher von Ihnen genutzten Leistungen ähnlich sind. Soweit im Rahmen der Verwendung der Daten eine Übermittlung in Länder ohne angemessenes Datenschutzniveau erfolgt, schaffen wir ausreichende Garantien zum Schutz der Daten. Außerdem verwenden wir Ihre Daten, soweit Sie uns hierfür eine Einwilligung erteilt haben. Sie können der Nutzung Ihrer Daten für Zwecke der Werbung oder der Ansprache per E-Mail oder Telefax jederzeit gegenüber der Informa Deutschland SE, Postfach 11 12 34, 40512 Düsseldorf widersprechen.

Zimmerreservierung.

Im Tagungshotel steht ein begrenztes Zimmerkontingent zum ermäßigten Preis zur Verfügung. **Bitte nehmen Sie die Reservierung direkt im Hotel unter dem Stichwort Handelsblatt-/EUROFORUM-Veranstaltung vor.**

Haben Sie Fragen zu dieser Veranstaltung? Wir helfen gerne weiter.

Carola Bergmann (Senior-Konferenz-Managerin Banken)

Anne Zenz (Konferenz-Koordinatorin)

Telefon: +49 (0)2 11.96 86 - 34 61