

## MaRisk für Vorstände

### Anmeldeformular

**MaRisk für Vorstände**

19. Oktober 2006 in Frankfurt am Main  
Seminar-Nr. 06 10 348

Name, Vorname

Position

Firma

Straße

PLZ/Ort

Tel.

Fax

E-Mail

Internet

Ansprechpartner/in im Sekretariat

Datum, Unterschrift

### Weitere Fragen? Gerne!

Für Ihre Fragen zum Seminar und unserem gesamten Programm stehe ich Ihnen gerne zur Verfügung.

#### Kirsten Pelke

Konferenzmanagerin  
Financial Services  
Tel.: 0 62 21/500-850 oder  
k.pelke@forum-institut.de

### So melden Sie sich an

#### Anmelde-Information:

FORUM · Institut für Management GmbH  
Postfach 10 50 60 · D-69040 Heidelberg

Seminar-Nr. 06 10 348 I  
Anmelde-Hotline: 0 62 21/500-501

Internet: www.forum-institut.de

#### Termin:

Donnerstag, 19. Oktober 2006, 9.00 bis 17.00 Uhr

#### Veranstaltungsort:

Radisson SAS Hotel  
Franklinstraße 65 · 60486 Frankfurt  
Tel. 0 69/77 01 55-0 · Fax 0 69/77 01 55-10

#### Gebühr:

€ 890,- (+ 16% MwSt.) incl. Dokumentation,  
gemeinsames Mittagessen, Erfrischungen.

#### Zimmerreservierung:

Für FORUM-Teilnehmer steht ein **begrenztes Zimmerkontingent** zu Vorzugskonditionen im Tagungshotel zur Verfügung. **Bitte beachten Sie**, dass das Abrufokontingent für Veranstaltungsteilnehmer automatisch 4 Wochen vor Veranstaltungsbeginn verfällt. **Bitte nehmen Sie die Zimmerreservierung direkt im Hotel vor** unter Berufung auf das FORUM-Kontingent und die Tagungsnummer.

### Allgemeine Geschäftsbedingungen

€ 50,- bis 2 Wochen vor Seminartermin, die hälftige Seminargebühr bis eine Woche vor Seminartermin, danach die volle Gebühr (jeweils zzgl. 16% MwSt.); Gerichtsstand ist Heidelberg. Im Übrigen gelten unsere AGB.

Anmeldung  
anmeldung@forum-institut.de  
Fax 0 62 21 / 500 555

Anmeldung

## FORUM für den Vorstand



# MaRisk für Vorstände

Top aktuell

- Aufsichtsrechtliche Normen
- MaRisk als Umsetzung internationaler Entwicklungen
- Inhalte und Umsetzung der MaRisk
- Gesamtverantwortung der Geschäftsleitung
- Allgemeine Anforderungen an das Risikomanagement



Renate Wagner

Bereichsleiterin Risikocontrolling  
DAB Bank, München



Dr. Alexander Suyter

Inhaber der Risk & Management  
Consultancy, München

FORUM · Institut für Management GmbH · Postfach 10 50 60 · D-69040 Heidelberg  
Tel. 0 62 21/500-500 · Fax 0 62 21/500-555 · www.forum-institut.de

19. Oktober 2006 in Frankfurt am Main

# MaRisk für Vorstände

## Seminarziel

Mit der bevorstehenden Umsetzung der MaRisk entstehen neue, umfangreiche und qualifizierte Anforderungen an die Kreditwirtschaft. Das Risikomanagement ist die zentrale Aufgabe des 21. Jahrhunderts für die Vorstände und Geschäftsführer der Kreditinstitute. Das Vertiefungs-Seminar hat zum Ziel, Sie mit den Problemfeldern eines professionellen Risikomanagements und -controllings in der Kreditwirtschaft vertraut zu machen. In praxisnaher Form wird Ihnen das für einen Vorstand/Geschäftsführer relevante Fachwissen für die tägliche Arbeit erläutert und umfassend dargestellt.

## Teilnehmerkreis

Das praxisnahe Seminar MaRisk für Vorstände wendet sich an:

- **Vorstände** und **Geschäftsführer**, die in ihrer täglichen Arbeit mit dem Risikomanagement betraut sind und vertiefendes Wissen über Risikomanagement und -controlling erhalten möchten.

aus **kreditwirtschaftlichen Verbänden** an:

- die Geschäftsführer und Organisatoren

## Teilnehmerbegrenzung

Die Teilnehmerzahl ist begrenzt auf **20!** Dies gewährleistet eine sinnvolle und praxisnahe Vermittlung von Wissen und einen intensiven Austausch zwischen den Teilnehmern und den Referenten.

## Ihre Experten

### *Dr. Alexander Suyter*

Inhaber der Risk & Management Consultancy, München

Dr. Alexander Suyter ist Inhaber der Risk & Management Consultancy in München. Schwerpunkte seiner Beratungstätigkeit liegen u.a. in den Themen Basel II, Baseler Prinzipien, aufsichtsrechtliche Mindestanforderungen (MaK, MaRisk), Risikomanagement und -controlling, Risikostrategie und Steuerung. Er ist zudem Referent auf Tagungen und Seminaren und publiziert als Autor einschlägige Beiträge in Fachzeitschriften und Kommentaren der Wirtschafts- und Finanzpresse. Vorher arbeitete er im Bereich Asset Management innerhalb eines großen Privatbank-Konzerns. Später wechselte Dr. Suyter zu einer deutschen Großbank und war dort langjährig u.a. als Projektleiter Rating- und Kreditrisikosteuerung verantwortlich, zuletzt als Leiter der Verfahrensumsetzung im Bereich Produktkonzeption von Handelsprodukten sowie als leitender Direktor für das Kreditrisikocontrolling.

### *Renate Wagner*

Bereichsleiterin Risikocontrolling, DAB Bank, München

Frau Wagner leitet den Bereich Risikocontrolling bei der DAB Bank. Zuvor war sie Senior Managerin im Bereich Financial Risk Management bei der KPMG sowie Risikoanalytikerin im Bereich Risk Management Support & Control bei der Westdeutschen Landesbank. Ihre Fachgebiete sind: Mindestanforderungen, Markt- und Liquiditätsrisiken, Adressausfallrisiken, operationelle Risiken sowie Gesamtbanksteuerung und Asset Liability-Management. Frau Wagner hat zahlreiche Konferenzen, Trainings und Seminare zu den Themen Liquiditätsmanagement, Risikomanagement, Finanzinstrumente, MaH und Aktiv-Passiv-Management durchgeführt.

# Programm

- 9:00 Uhr ■ **Einleitung**
- Begrüßung der Teilnehmer
  - Zielsetzung des Seminars, Abgleich mit den Erwartungen der Teilnehmer
- 9:15 Uhr ■ **Aufsichtsrechtliche Normen**
- Gesetzliche Normen der Bankenaufsicht
  - Aufsichtsrechtliche Begriffsabgrenzung bei Risikoidentifikation
- 9:30 Uhr ■ **MaRisk als Umsetzung internationaler Entwicklungen**
- Baseler Prinzipien zu den verschiedenen Risikoarten
  - Basel II Säule II
  - EU-Umsetzung
  - Umsetzung in Deutschland
- 9:45 Uhr ■ **Inhalte und Umsetzung der MaRisk**
- Struktur der MaRisk
  - Anwendungsbereich
  - Gesamtverantwortung der Geschäftsleitung
  - **Allgemeine Anforderungen an das Risikomanagement**  
Risikotragfähigkeit, Risikostrategie • Internes Kontrollsystem • Interne Revision • Risikosteuerung und -controllingprozesse allgemein • Organisatorischer Rahmen (Aufbauorganisation)
- 15-minütige Kaffeepause
- 11:00 Uhr - **Risikosteuerung und -controllingprozesse des Marktpreisrisikos und des operationalen Risikos**  
Anforderungen an die Prozesse • Anforderungen an Neuerungen durch die MaRisk an das Management von Marktpreisen inkl. Zinsrisiken im Handels- und Anlagebuch • Liquiditätsrisiken • Operationelle Risiken
- 12:00 Uhr - **Anforderungen und Neuerungen für das Handelsgeschäft**  
Ablauforganisation • Prozesse
- 1-stündiges Mittagessen
- 13:30 Uhr - **Anforderungen und Neuerungen für das Kreditgeschäft**  
Ablauforganisation und Prozesse • Funktionstrennung, Markt, Marktfolge, Votierung
- 14:00 Uhr - **Risikomanagement des Adressausfallrisikos**  
Management Adressausfallrisiko gemäß MaRisk • Risikoklassifizierung
- **Risikosteuerung und -überwachung des Adressausfallrisikos**  
Kreditrisikostrategie, Risikobericht • Risikotragfähigkeit, Risikolimitierung, Risikoszenarien • Risikosteuerung
- 15-minütige Kaffeepause
- 15:15 Uhr - **Rahmenbedingungen**  
Organisationsrichtlinien, Dokumentation • Ressourcen (Personal, technisch-organisatorische Ausstattung, Notfallkonzept) • Neuprodukt- und Neue-Märkte-Prozess (MaH, MaK) • Outsourcing
- 16:15 Uhr - **Ausgestaltung der Internen Revision**  
Aufgaben und Grundsätze • Risikoorientierte Prüfungsplanung und -durchführung
- Zeitplan und Fazit