

Informationen

Zielgruppe

Dieses Seminar richtet sich insbesondere an Mitarbeiter und Führungskräfte in den Bereichen Risikocontrolling und -management, Treasury, Asset & Liability Management, Liquiditätssteuerung und -management, Depot-A-Management, Kreditportfoliomanagement, Finanzen, Geldhandel und Interne Revision bei Kreditinstituten, Versicherungen und Finanzdienstleistern. Darüber hinaus werden auch Berater, Wirtschaftsprüfer, Analysten und Softwareentwickler angesprochen, die Dienstleistungen im Bereich Risiko- und Liquiditätsmanagement anbieten.

Anmeldung

So melden Sie sich an:

per Telefon:
08151/27 19-0

per Telefax:
08151/27 19-19

per E-Mail:
info@management-
forum.de

per Internet:
www.management-
forum-starnberg.de

Management Forum Starnberg GmbH
Maximilianstraße 2b · D-82319 Starnberg

Teilnahmegebühr

Die Gebühr für die zweitägige Veranstaltung beträgt € 1.695,- zzgl. 19% MwSt. Sollten mehr als zwei Personen aus einem Unternehmen an der Veranstaltung teilnehmen, gewähren wir **ab dem dritten Teilnehmer 15% Preisnachlass**. Die Teilnahmegebühr enthält Getränke, Kaffeepausen, Mittagessen sowie ausführliche Arbeitsunterlagen. Jede Anmeldung wird von Management Forum Starnberg schriftlich bestätigt. Nach Anmeldung erhalten Sie die Rechnung. Die Veranstaltungsteilnahme setzt Rechnungsausgleich voraus. Mit Ihrer Anmeldung erkennen Sie unsere Teilnahmebedingungen an. Programmänderungen aus aktuellem Anlass behalten wir uns vor.

Termine und Orte

4. und 5. September 2008 in Frankfurt am Main

Fleming's Hotel Frankfurt An der Neuen Börse
Elbinger Straße 1-3 · 60487 Frankfurt
Telefon: 069/506040-0 · Telefax: 069/506040-999
E-Mail: reservation.fra.neueboerse@flemings-hotels.com
Zimmerpreis: € ???,- inkl. Frühstück

4. und 5. Dezember 2008 in München

Novotel München City
Hochstraße 11 · 81669 München
Telefon: 089/66107-0 · Telefax: 089/66107-999
E-Mail-Reservierung: h3280@accor.com
Zimmerpreis: € ???,- inkl. Frühstück

Zimmerreservierung

Für dieses Seminar steht in den Tagungshotels ein begrenztes Zimmerkontingent zur Verfügung. Bitte nehmen Sie die Buchung **direkt im Hotel** unter Berufung auf Management Forum Starnberg GmbH vor.

Registrierung

Der Konferenz-Counter ist ab 8.30 Uhr zur Registrierung geöffnet. Als Ausweis für die Teilnahme gelten Namensplaketten, die vor Beginn zusammen mit den Arbeitsunterlagen ausgehändigt werden.

Rücktritt

Bei Stornierung der Anmeldung wird eine Bearbeitungsgebühr in Höhe von € 55,- zzgl. 19% MwSt. pro Person erhoben, wenn die Absage spätestens zwei Wochen vor dem jeweiligen Veranstaltungstermin schriftlich bei Management Forum Starnberg GmbH eingeht. Bei Nichterscheinen des Teilnehmers bzw. einer verspäteten Abmeldung wird die gesamte Seminargebühr fällig. Selbstverständlich ist eine Vertretung des angemeldeten Teilnehmers möglich.

Management Forum Starnberg

Als Veranstalter von Fachkonferenzen und -seminaren für Führungskräfte steht Management Forum Starnberg für
– professionelle Planung, Organisation und Durchführung
– aktuelle Themen und sorgfältig recherchierte Inhalte
– Zusammenarbeit mit namhaften Referenten
– viel Raum für informative Diskussionen und interessante Kontakte

Inhouse-Schulungen

Zu diesem und zahlreichen anderen Themen bieten wir Ihnen auch individuell auf Ihr Unternehmen zugeschnittene Inhouse-Schulungen an. Gerne unterbreiten wir Ihnen ein unverbindliches und individuelles Angebot.
Ihr Ansprechpartner: Peter Bartl, Tel.: 08151/2719-0, peter.bartl@management-forum.de

Anmeldung unter Fax 0 81 51/27 19-19 oder www.management-forum.de/risikosteuerung

Bitte Coupon fotokopieren oder ausschneiden und im Briefumschlag oder per Fax an: Management Forum Starnberg GmbH, Maximilianstraße 2b, D-82319 Starnberg

Ja, hiermit melde ich mich für das Intensivseminar
**Risikosteuerung und
Liquiditätsmanagement** an:

- am 4. und 5. September 2008 in Frankfurt/M.
oder
 am 4. und 5. Dezember 2008 in München

1. Name _____	2. Name _____
Vorname _____	Vorname _____
Position _____	Position _____
Abteilung _____	Abteilung _____
Firma _____	
Straße/PF _____	PLZ / Ort _____
Telefon _____	*Telefax _____
*E-Mail _____	
Branche _____	Beschäftigtenzahl: ca. _____
Datum _____	Unterschrift _____

**Management Forum
Starnberg GmbH
Frau Claudia Fink
Maximilianstraße 2b**

D-82319 Starnberg

X 4266 /4267

Sollten Sie Ihre Anmeldung bis spätestens zwei Wochen vor dem jeweiligen Veranstaltungstermin stornieren (schriftlich bei uns eingehend), berechnen wir Ihnen eine Bearbeitungsgebühr von € 55,- zzgl. 19% MwSt. pro Person. Bei Nichterscheinen bzw. bei einer verspäteten Absage ist die gesamte Veranstaltungsgebühr fällig. Selbstverständlich ist eine Vertretung des angemeldeten Teilnehmers möglich. *Mit der Nennung Ihrer E-Mailadresse und/oder Faxnummer erklären Sie sich einverstanden, dass wir Sie auch per E-Mail und/oder Fax über unser aktuelles Angebot informieren dürfen.

**4./5. September 2008 in Frankfurt/M. oder
4./5. Dezember 2008 in München**



Risikomanagement und Liquiditätssteuerung

Finanzrisiken richtig einschätzen und effektiv kontrollieren

- ✓ Risikomanagement modern und proaktiv gestalten
- ✓ Aufsichtsrechtliche Entwicklungen berücksichtigen
- ✓ Kreditderivate in der Risikosteuerung nutzen
- ✓ Bankinternes Kapitalmanagement konsistent integrieren
- ✓ Best Practice im Liquiditätsmanagement umsetzen
- ✓ Robustes Marktrisiko- und Liquiditätsmanagement bei volatilen Märkten



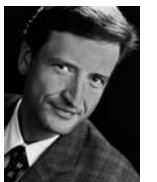
Mit Praxisbeispielen von:

Josef Gruber
Bayerische Landesbank

Dr. Stefan Zeranski
Kölner Bank eG

Ihr Seminarleiter:

Dr. Alexander Suyter
RIMC Risk & Management Consultancy



Vertiefen Sie Ihr Know-how im Kreditrisikomanagement und -handel

Das Programm

Lernen aus den Turbulenzen an den Finanzmärkten

In Finanzmarktkrisen wird nachdrücklich die immense Bedeutung deutlich, die einem robusten und effektiven Risiko- und Liquiditätsmanagement in Zeiten globalisierter Finanzmärkte zukommt.

Es herrscht Unsicherheit in der Branche. Welche versteckten Risiken lauern noch in Bankportfolios? Welche Entwicklung nehmen die aufsichtsrechtlichen Anforderungen? Wie kann kurz- und langfristige Liquidität sichergestellt und nachgewiesen werden? Wie ist das interne Risikomanagement umzustrukturieren?

Diese Veranstaltung soll Ihnen helfen, Ihre Risiko- und Liquiditätssteuerung krisenfest zu gestalten. Nutzen Sie diese Gelegenheit, die richtigen Lehren aus der Vergangenheit und den jüngsten Entwicklungen zu ziehen! Profitieren Sie von der Praxiserfahrung unserer Referenten und dem intensiven Erfahrungsaustausch mit Kollegen – lernen Sie, wie Sie in volatilen Märkten Risiken absichern und Gewinne erzielen können!

1. Seminartag

Ihr Seminarleiter:

Dr. Alexander Suyter,

RiMC Risk & Management Consultancy, München

Risikomanagement und aufsichtsrechtliche Entwicklungen

- Begrüßung und Einleitung
- Identifizierung der Risiken
 - Risiken der internen Banksteuerung
 - Aufsichtsrechtliche Risikoabgrenzung
- Aufsichtsrechtliche Entwicklungen
 - International: Basel und Basler Prinzipien
 - Europa: CEBS (London)
 - Richtlinien der EU (Brüssel, u.a. Bankenrichtlinie, Kapitaladäquanzrichtlinie)
 - Wie weit geht die regulatorische Kapitalunterlegung?
 - Welche Auswirkungen hat die Subprime Krise auf die Regulierung?
 - Umsetzung in Deutschland (BMF, BaFin, Bundesbank)
 - Home Host Fragen (Heimat- und Gastlandaufsicht)

- Risikosteuerung aus Sicht der Aufsicht und des internen Risikomanagements
 - Aufsicht: Standard- und interne Ansätze im Kreditrisiko, Sicherheitenanrechnung
 - Methodische und qualitative Anforderungen
 - Beispiele
 - Bankinterne Verfahren und Parametrisierung
 - Bankinterne Risikoparameter als strategische Entscheidung?
 - Aufsichtliche Modellwelt und bankinternes Vorgehen
 - Bedeutung der Ansatzwahl in Säule 1 (u.a. Basel II: KSA, IRBA) für die interne Risikosteuerung

Dr. Alexander Suyter

Kreditderivate in der Risikosteuerung

- Kurzeinführung in Kreditderivate
- Der Markt für Kreditderivate
- Verhalten der Kreditderivate, der Indizes und der Marktakteure in der Krise
- CDS Spreads in unterschiedlichen Marktphasen
- iTraxx als Frühwarnindikator für volatile Märkte
- Kreditrisikopricing mit Kreditderivaten
- Bedeutung und Nutzen von Kreditderivaten in der Kreditrisikosteuerung
 - für Kreditbereiche
 - für andere Handelsbereiche
 - für Kreditrisikomesssysteme

Josef Gruber,

Bayerische Landesbank, München

2. Seminartag

Ihr Seminarleiter:

Dr. Alexander Suyter

Bankinternes Kapitalmanagement

- Erfolgreiche interne Kapitalsteuerung
 - Risikoadjustierte Bewertung von Cash Flow Strukturen
 - Wesentliche Risikosteuerungs- und Controllingprozesse
 - Organisation des Risikomanagements innerhalb der Bank
 - Zentrale Verantwortung der Geschäftsleitung
 - Geschäfts- und Risikostrategie in Zeiten unterschiedlicher Finanzmärkte
 - Risikotragfähigkeitsrechnung und Berichterstattung
 - Maßnahmen des Bankmanagements als Folge von Risikoszenarien

Das Programm

- Risikolimitierung
- Beispiele

■ Zeitplan und Fazit

Dr. Alexander Suyter

Liquiditätsrisikomanagement im Licht der Subprime Krise

- Grundlagen und Regulierung des Liquiditätsrisikos im Licht der Subprime Krise
 - Liquidität, Liquiditätsrisiko, Liquiditätsrisikomanagement in Banken
 - Nationale Regulierung des Liquiditätsrisikomanagements in Banken
 - Anforderungen an interne Liquiditätsrisikomodelle § 10 LiqV
 - Grundzüge der Cash Flow Modellierung für das Liquiditätsrisiko in Banken
 - Lehren aus der Subprime Krise für das Liquiditätsrisikomanagement in Banken
 - Internationale Harmonisierung der Liquiditätsregulierung in Banken
- Best Practice im Liquiditätsrisikomanagement
 - Entwicklungsstufen und Schwachstellen im Liquiditätsrisikomanagement in Banken
 - Liquidity at Risk, Liquidity-Value at Risk, Stresstests zur Risikoanalyse in Banken
 - Kurzfristiges versus strukturelles Liquiditätsrisikomanagement in Banken
 - Aufbauorganisation – Organisation der Zuständigkeiten (zentral vs. dezentral)
 - Limitstrukturen und Stressauslastung
 - Effizientes Reporting
 - Liquiditätsrisiko in der LiqV-Standardverfahren-Erfüllung
 - Revision des Liquiditätsrisikomanagements in Banken

Dr. Stefan Zeranski,

Kölner Bank eG, Köln

Moderierte Abschlussdiskussion / Fazit

Zeitlicher Rahmen:

Erster Tag:

9.30 Beginn des Seminars

12.30 Gemeinsames Mittagessen

ca. 17.30 Ende des Seminartages

Zweiter Tag:

9.00 Beginn des Seminars

12.30 Gemeinsames Mittagessen

ca. 17.00 Ende des Seminartages

Die Kommunikations- und Kaffeepausen werden im Verlauf des Seminars festgelegt.

Ihre Referenten

Dr. Alexander Suyter ist Inhaber der RiMC Risk & Management Consultancy in München. Er berät Institute aller Sektoren im In- und Ausland. Schwerpunkte der Beratungs- und Projektstätigkeit liegen in den Themen Basel II, EU-Richtlinien und nationale Umsetzung (u.a. SolvV, MaH, MaK, MSK, MaRisk), Risikomanagement und -controlling, Strategie, Steuerung, Rating, Risikoüberwachung, Reporting, Meldewesen, insbes. in der Vernetzung und Umsetzung der Fragestellungen. Er ist zudem Referent und Vorsitzender auf Konferenzen und Seminaren, Fachbuchherausgeber und Buch-Co-Autor und publiziert in verschiedenen Fachzeitschriften. Vorher arbeitete er im Asset Management eines Privatbankkonzerns, später war er in einer deutschen Großbank langjährig verantwortlich u.a. als Gesamtprojektleiter Rating- und Kreditrisikosteuerung, als Leiter der Verfahrensumsetzung im Bereich Produktkonzeption von Handelsprodukten sowie als leitender Direktor für das Kreditrisikocontrolling.

Josef Gruber, Diplom-Mathematiker, ist Leiter der Einheit »Credit Risk Management« bei der Bayerischen Landesbank in München. Nach seinem Studium an der Universität Regensburg begann er seine berufliche Tätigkeit mit der Konzeption neuer Handelsprodukte, bevor er als Risikomanager im Wertpapierhandel für die Risiko- und Ergebnisrechnung zuständig war. In dieser Funktion wirkte Josef Gruber bei der Einführung von Kreditderivaten in der Bayerischen Landesbank mit und übernahm Ende 1998 als Chefhändler die Verantwortung für dieses Segment.

Dr. Stefan Zeranski ist seit 2004 Leiter Treasury bei der Kölner Bank eG. Im Anschluss an Studium und ein Traineeprogramm bei der Deutschen Bank AG war er beim Genossenschaftsverband Sachsen in der Stabsstelle der Prüfungsdienstleitung und bei der SchmidtBank KGaA, dort u.a. als Leiter Aktiv-Passiv-Management tätig. Nach seiner Dissertation über Liquidity at Risk, die mit summa cum laude und dem Sonderforschungspreis der Commerzbank AG ausgezeichnet wurde, arbeitet Herr Zeranski seit 2006 berufsbegleitend an seiner Habilitation im Fach Finanzwirtschaft und Bankbetriebslehre.

Inhouse-Schulungen

Zu diesem und zahlreichen anderen Themen bieten wir Ihnen auch individuell auf Ihr Unternehmen zugeschnittene Inhouse-Schulungen an. Gerne unterbreiten wir Ihnen ein unverbindliches und individuelles Angebot.

Ihr Ansprechpartner:

Peter Bartl, Tel.: 08151/2719-0, peter.bartl@management-forum.de