

Handelsblatt Financial Trainings

3. Novelle der MaRisk

Stresstesting

- separat buchbar -

Aktuelle Änderungen, erste Erfahrungen und Prüfungspraxis im Kontext von Basel III

▶ 16. Februar 2011, Frankfurt am Main
14. März 2011, München

▶ 17. Februar 2011, Frankfurt am Main
15. März 2011, München

- ▶ 3. MaRisk-Novelle im Kontext von Basel III
- ▶ Strategien – mehr als eine Dokumentationsübung
- ▶ Notwendigkeit und Ausgestaltung von Stresstests
- ▶ Liquiditätsrisiken: Wesentliche Änderungen
- ▶ Risikokonzentration und Risikodiversifikation
- ▶ Auswirkungen auf die Prüfungspraxis, Praxis-Erfahrungen

Die Referenten:



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



Dr. Alexander Suyter,
Inhaber,
Risk & Management Consultancy



Stephan Bellarz,
Abteilungsleiter,
DZ BANK AG

- ▶ Aufsichtsrechtliche Position zu Art und Umfang der Stresstests, insbes. Reverse Stresstests
- ▶ Lessons learned aus den CEBS-Stresstests
- ▶ Einbindung in die Gesamtbanksteuerung
- ▶ Stresstest für Liquiditäts-, Kredit-, Marktrisiken
- ▶ Praktische Umsetzung und lessons learned

Die Referenten:



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



Jochen Peppel,
Senior Manager,
Oliver Wyman GmbH



Dr. Ulrich von Zanthier,
Leiter Risikocontrolling,
DekaBank Deutsche Girozentrale



„Banken fürchten noch strengere Regulierung“

(HB, 14.10.10)

„Risikomanager: Vom Spielverderber zum Helden“

(Bankmagazin 7/10)

Eine Fülle von Regularien überschwemmt seit Monaten die Bankenlandschaft – ein Ende ist noch nicht in Sicht. Neben der erneuten Novelle der MaRisk prägen insbesondere Basel III sowie zahlreiche CEBS-Papiere das Geschehen.

Doch was beinhalten diese Regelungen genau? Wie soll ihre konkrete Umsetzung aussehen? Was beinhaltet die Prüfung durch die Aufsicht? Ihnen als Risikomanager kommt seit der Finanzkrise eine zentrale Rolle zu – wir unterstützen Sie dabei, diese kompetent und erfolgreich auszufüllen:

Im Rahmen des Handelsblatt Financial Trainings „Novelle der MaRisk/Stresstesting“ werden die Änderungen ausführlich durch einen Vertreter der Bundesbank erläutert. Die konkrete Umsetzung der Regelungen sowie Erfahrungen mit der letzten MaRisk-Novelle werden dabei ebenso diskutiert wie die flankierenden Neuerungen in Basel III.

Am zweiten, separat buchbaren Tag mit dem Schwerpunkt „Stresstesting“ wird neben einer aufsichtsrechtlichen Beleuchtung aufgezeigt, welche Stresstests in welchem Umfang Sinn machen und wie diese in der Praxis umgesetzt werden.

Info-Telefon: +49 (0)2 11.96 86–34 63

Haben Sie Fragen zu dieser Veranstaltung?

Wir helfen Ihnen gerne weiter.

Konzeption und Inhalt



Carola Bergmann

Senior-Konferenz-Managerin Banken

EUROFORUM

E-Mail: carola.bergmann@euroforum.com

Organisation



Friederike Hintze

Senior-Konferenz-Koordinatorin Banken

EUROFORUM

E-Mail: friederike.hintze@euroforum.com

3. Novelle der MaRisk: Sämtliche Änderungen und ihre Konsequenzen, Umsetzung und Prüfungspraxis

9.00–9.30

Empfang mit Kaffee und Tee, Ausgabe der Seminarunterlagen

9.30–11.00

MaRisk als „Daueraufgabe“ –

Schwerpunkte der MaRisk-Novelle 2010

- Motivation, Zeitplan
- Was ist neu? –
 - Die wesentlichen Neuerungen im Überblick, u. a.
 - Strategien – mehr als eine Dokumentationsübung
 - Notwendigkeit und Ausgestaltung von Stresstests – neues Modul AT 4.3.3
 - Wesentliche konzeptionelle Änderungen im Bereich Liquiditätsrisiken
 - Umgang mit Risikokonzentration und Risikodiversifikation
 - Auswirkungen auf die Prüfungspraxis, Konsequenzen

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

11.00–11.30 **Pause mit Kaffee und Tee**

11.30–13.30

3. MaRisk-Novelle im Kontext von Basel III

- Was ist Basel III
- Umsetzung in der EU und Deutschland
- Neue Kapitalstandards
- Eigenkapitalstruktur
- Kapitalpuffer
- Übergangsphasen

Dr. Alexander Suyter, Inhaber, Risk & Management Consultancy

13.30–14.30 **Gemeinsames Mittagessen**

14.30–16.30

Erste Praxis-Erfahrungen sowie Lessons learned aus der Novelle 2009

- Umsetzung der aufsichtlichen Anforderungen in die Praxis
- Risikotragfähigkeit auf Gruppenebene
- Berücksichtigung von Risikokonzentrationen und -aggregationen
- Stresstests als Risikomanagementinstrument
- Kapitalmanagement zwischen MaRisk und SolvV
- Prüfungserfahrungen zur Umsetzung der aufsichtlichen Anforderungen

Stephan Bellarz, Abteilungsleiter, DZ BANK AG

16.30–17.00 **Abschlussdiskussion**

17.00 **Ende des ersten Trainingstages**

Stresstests: Verschärfte Anforderungen, Methoden, Praxis

8.30–9.00

Empfang mit Kaffee und Tee, Ausgabe der Seminarunterlagen

9.00–10.30

Aufsichtsrechtliche Anforderungen zu Art und Umfang von Stresstests

- Wichtige Aspekte aufsichtsrechtlicher Anforderungen (MaRisk, CEBS, etc.)
- Reverse stress tests

CEBS-Stresstest: Ergebnisse und Lessons Learned

- Was-wäre-wenn und Event Study Perspektive
- Implikationen für die Finanzindustrie

10.30–11.00 Pause mit Kaffee und Tee

11.00–12.30

Risikoarten-übergreifende Stresstests und Einbindung von Stresstests in die Gesamtbanksteuerung

- Integration von Stresstest und Szenarioanalysen über Risikoarten hinweg
- Bedeutung von Stresstests in Gesamtbanksteuerung und Kapitalmanagement, Fallbeispiel

12.30–13.30 Gemeinsames Mittagessen

13.30–15.00

Ökonomisch-basierte Stresstest für einzelne Risikoarten

- Stresstest für Liquiditäts- und Funding-Risiken
 - Ableitungsschritte bei der Umsetzung
 - Anwendung im Liquiditäts- und Funding-Management
- Stresstest für Kreditrisiken
 - Konzeption, Identifikation von Stressszenarien
 - Anwendung im Portfolio-Management
- Stresstest für Marktrisiken
 - Stresstest und VaR
 - Ableitungsschritte bei der Szenarioentwicklung, Umsetzung
 - Anwendung der Stresstest-Ergebnisse

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

PRAXISBERICHT

Lessons learned und praktische Umsetzung

- Motivation und Zielsetzung von Stresstests
- Definition und Kategorisierung von Stresstests
- Szenarioerhebung und -modellierung
- Einbindung der Stresstests in die Steuerung

Dr. Ulrich von Zanthier, Leiter Risikocontrolling, DekaBank

17.00

Abschlussdiskussion und
Ende des zweiten Trainingstages

Ihre Experten:



Johann Kalkbrenner ist als Referatsleiter im Regionalbereich Banken und Finanzaufsicht in der Hauptverwaltung München der Deutschen Bundesbank tätig. In seinen Verantwortungsbereich fällt die Leitung von Bankgeschäftlichen Prüfungen nach § 44 KWG. Daneben war bzw. ist er in diversen bankaufsichtlichen Arbeitsgruppen tätig.



Dr. Alexander Suyter ist Inhaber der RiMC Risk & Management Consultancy in München. Er berät Institute aller Sektoren in Deutschland und anderen EU-Ländern. Schwerpunkte der Beratungs- und Projektstätigkeit liegen in den Themen Basel II, EU-Richtlinien und nationale Umsetzung (u.a. MaRisk), Risikomanagement, Reporting und Meldewesen. Er ist zudem Referent und Autor. Vorher arbeitete er im Asset Management eines Privatbank-Konzerns, 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.



Stephan Bellarz ist als Abteilungsleiter in der Revision der DZ BANK AG für das Prüfungsgebiet der Bank- und Risikosteuerung zuständig. Er verantwortet in dieser Funktion die Leitung der relevanten Prüfungen im In- und Ausland sowie für den Konzern. Seit über zehn Jahren beschäftigt sich Stephan Bellarz mit der Risikosteuerung und den Kontrollsystemen von Kreditinstituten. Nach seinem betriebswirtschaftlichen Studium hat er als Consultant für das Beratungsunternehmen BARRA International institutionelle Assetmanager bei der Umsetzung quantitativer Investmentstrategien und Performanceanalysen beraten. Anschließend baute Stephan Bellarz das Marktrisikocontrolling in der Nassauischen Sparkasse auf, bevor er zur Dresdner Bank AG wechselte. Hier leitete er mehrere Jahre den Bereich ALM-Risikocontrolling und Kapitalanalyse.



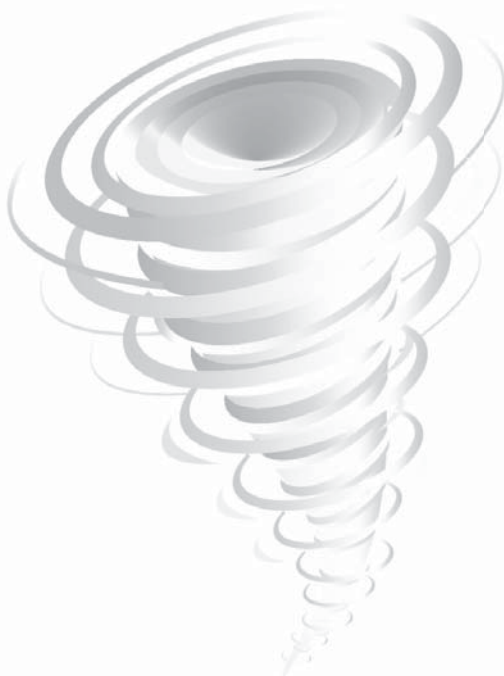
Jochen Peppel ist seit 2002 bei Oliver Wyman und Senior Manager in der Praxisgruppe Finance & Risk im Frankfurter Büro. Er verfügt über umfangreiche Projekterfahrungen bei europäischen Banken in der Entwicklung und Implementierung von Modellen und Prozessen in den Bereichen Risiko- und Portfoliomanagement. In den letzten Jahren hat sich Herr Peppel verstärkt der praktischen Umsetzung regulatorischer Anforderungen unter Säule II zugewandt und namhafte Institute u.a. zum Thema Stresstesting beraten. Jochen Peppel ist Wirtschaftsingenieur und zertifizierter „Financial Risk Manager“ (FRM) der „Global Association of Risk Professionals“ (GARP).



Dr. Gerhard Schröck ist seit 1997 bei Oliver Wyman und Partner in der Praxisgruppe Finance & Risk im Frankfurter Büro. Er verfügt über umfangreiche Projekterfahrungen bei europäischen Banken und Kreditversicherungsunternehmen in der Entwicklung und Implementierung von Modellen, Instrumenten und Prozessen in den Bereichen Risikobewertung und Risikomanagement. Zudem hat Gerhard Schröck langjährige Erfahrung im Bereich wertbasiertes Management und Gesamtbanksteuerung. In den letzten drei Jahren hat sich Herr Dr. Schröck insbesondere auch mit Aufgabenstellungen im Bereich Risiko-Organisation und -Governance und vor allem im Bereich Stress-Testing beschäftigt.



Herr Dr. Ulrich von Zanthier ist Leiter Risikoccontrolling bei der DekaBank und in dieser Funktion für die Risikomessung und -überwachung des Konzerns einschließlich der Stresstests zuständig. Nach seinem Studium der Volkswirtschaftslehre war Herr von Zanthier zwölf Jahre lang für verschiedene Beratungsgesellschaften tätig. Vor seinem Eintritt in die DekaBank hat er zuletzt als Vice President bei Capgemini Consulting das deutsche Beratungssegment Risk & Finance und das globale Kompetenzzentrum Risk Management geleitet.



Weitere Informationen finden Sie unter:

www.handelsblatt.com/training

Dieses Training ist konzipiert für:

Führungs- und Fachkräfte aus Banken
aus den Bereichen:

- (Risiko-) Controlling und Risikomanagement
- Gesamtbanksteuerung
- Meldewesen
- Revision und Grundsatzfragen

Daneben sprechen wir Verbandsvertreter,
Wirtschafts-, Steuer- und
Unternehmensberater an.

3 gute Gründe für das MaRisk-Training:

- 1 Sie erhalten einen komprimierten Einblick in alle Änderungen der 3. MaRisk-Novelle und den Kontext durch Basel III
- 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

3 gute Gründe für das Stresstest-Training:

- 1 Sie erfahren, welche Konsequenzen Sie aus den CEBS-Stresstests ziehen sollten
- 2 Sie lernen, welche Stresstests wirklich Sinn machen und welcher Umfang gefordert ist
- 3 Sie profitieren von lessons learned aus der Praxis

Profitieren Sie von top-aktuellem
Know-how aus erster Hand und
Praxis!

**Diese Handelsblatt Trainings
sind separat buchbar**

(Kenn-Nummer)

3. Novelle der MaRisk | Stresstesting

Machen Sie sich fit für die verschärften Anforderungen!
– separat buchbar –

16. und 17. Februar 2011, Novotel Frankfurt City

Lise-Meitner-Straße 2, 60486 Frankfurt, Telefon: 069.79303-0

14.–15. März 2011, Hotel Excelsior München

Schützenstraße 11, 80335 München, Telefon: 089.55137-0

Bitte ausfüllen und faxen an: 02 11.96 86-40 40

Ja, ich nehme teil. Preis zzgl. MwSt. pro Person.

	in Frankfurt am Main [P1200414]	in München [P1200415]
MaRisk und Stresstesting	<input type="checkbox"/> 16. und 17. Februar 2011 Preis € 1.999 [M012]	<input type="checkbox"/> 14. und 15. März 2011 Preis € 1.999 [M012]
MaRisk	<input type="checkbox"/> 16. Februar 2011 Preis € 1.299 [M100]	<input type="checkbox"/> 14. März 2011 Preis € 1.299 [M100]
Stresstesting	<input type="checkbox"/> 17. Februar 2011 Preis € 1.299 [M200]	<input type="checkbox"/> 15. März 2011 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 86-33 33.

Name, Vorname	
Position/Abteilung	
Telefon	Fax
E-Mail	Geb.-Datum (TTMMJJJJ)

Die EUROFORUM 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
Anschrift
Branche
Ansprechpartner im Sekretariat

Datum, Unterschrift

Bitte ausfüllen, falls die Rechnungsanschrift von der Kundenanschrift abweicht:

Name
Abteilung
Anschrift

Wer entscheidet über Ihre Teilnahme? Ich selbst oder Name: _____

Position: _____

Beschäftigtenzahl an Ihrem Standort: bis 20 21-50 51-100 101-250 251-500 501-1000 1001-5000 über 5000

Teilnahmebedingungen. Der Teilnahmebetrag für diese Veranstaltung inklusive Tagungsunterlagen, Mittagessen, Pausengetränken und Abendessen beträgt € 1.999,- für zwei Tage zzgl. MwSt. p.P. und € 1.299,- für einen Tag zzgl. MwSt. p.P. und 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. Die Handelsblatt GmbH und die EUROFORUM 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 EUROFORUM 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-Konferenz vor. Änderungen vorbehalten.

Ihre Tagungshotels.

Novotel Frankfurt City, Lise-Meitner-Straße 2, 60486 Frankfurt
Telefon: 069.79303-0

Am Abend des ersten Tages lädt Sie das Novotel Frankfurt City herzlich zu einem Umtrunk ein.



Hotel Excelsior München, Schützenstraße 11, 80335 München
Telefon: 089.55137-0

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 die EUROFORUM Deutschland SE beauftragt.

Anmeldung und Information

per Fax: +49 (0)2 11.96 86-40 40

telefonisch: +49 (0)2 11.96 86-34 63
[Friederike Hintze]

Zentrale: +49 (0)2 11.96 86-30 00

schriftlich: EUROFORUM Deutschland SE
Postfach 11 12 34, 40512 Düsseldorf

per E-Mail: anmeldhb@euroforum.com

im Internet: www.handelsblatt.com/training