



IFF

Ein Geschäftsbereich der IIR Deutschland GmbH

Mit Praxisberichten!

»Fundierter
Gesamtüberblick
über die Vorschriften durch
kompetente Dozenten.«
Olaf Detlefsen,
Deutsche Genossenschafts-
Hypothekenbank,
Hamburg

MaRisk

Umsetzung und Weiterentwicklung

Ihre Experten

- **Dr. Alexander Suyter**
Risk & Management
Consultancy, München
- **Daniel Chouchane**
Landesbank Hessen-
Thüringen, Frankfurt/Main
- **Udo Henkelmann**
Xchanging Transaction Bank
GmbH, Frankfurt/Main

Termine und Kursorte

- **05. – 06. Mai 2008**
Offenbach bei Frankfurt/Main
- **18. – 19. August 2008**
Frankfurt/Main

Seminarschwerpunkte

- MaRisk als Umsetzung **internationaler Entwicklungen**
- **Inhalte und Umsetzung** der MaRisk – Anforderungen an das Risikomanagement
- **Risikosteuerung und -controllingprozesse**
- Management von **Adressausfallrisiko, Liquiditätsrisiko, Zinsänderungsrisiko, Marktrisiko und operationellem Risiko**
- **Aufbauorganisation und Prozesse** des Kreditgeschäfts
- **Operationelles Risiko und Outsourcing**
- Ausgestaltung der **Internen Revision**
- Darstellung der **Weiterentwicklung des MaRisk**



IFF



ZUM SEMINARTHEMA

Die MaRisk sind bereits seit Dezember 2005 in Kraft. Am 1. Januar 2008 ist die Übergangsfrist abgelaufen und alle Banken müssen angemessene Risikokontrollen einsetzen. In unserem zweitägigen Intensivseminar erhalten Sie einen umfassenden Überblick über die Regelungen der MaRisk, aktuelle Auslegungsfragen, Öffnungsklauseln sowie Hinweise zur angemessenen Umsetzung. Im Rahmen von Praxisberichten erfahren Sie, wie die Helaba und die Xchanging Transaction Bank mit den Themen Risikosteuerung und Outsourcing umgehen.

Nutzen Sie die Möglichkeit zur Diskussion und intensivem Erfahrungsaustausch mit den Referenten und den anderen Teilnehmern!

FÜR WEN IST DIESER KURS KONZIPIERT?

Dieses Seminar richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus Banken, Sparkassen, Volks- und Raiffeisenbanken aus den Bereichen **(Risiko-) Controlling, Depot-A- und Risikomanagement, Kredit, Treasury, Handel, Abwicklung, Finanz- und Rechnungswesen, Meldewesen, Bilanzierung und Steuern, Revision, Grundsatzfragen**. Auch für Verbandsvertreter, Wirtschafts-, Steuer- und Unternehmensberater ist dieser Kurs sehr interessant.



IHR REFERENTENTEAM

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. SolV, MaH, MaK, 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 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.

Daniel Chouchane



studierte nach einer Ausbildung zum Bankkaufmann Bankbetriebswirtschaftslehre in Frankfurt und Caen (Frankreich). Nach Abschluss eines deutsch-französischen Doppeldiploms war er im Bereich Konzernentwicklung bei der Commerzbank AG in Frankfurt tätig. In 2000 wechselte er innerhalb der Commerzbank in den Bereich Treasury, wo er als stellvertretender Leiter der Aktiv-Passiv-Steuerung mit dem Aufbau einer GuV sowie der Analyse und Steuerung der Zinsänderungsrisiken aus dem Bankbuch beauftragt wurde. Seit April 2007 leitet er die Fristenablausteuern in der Aktiv-Passivsteuerung der Landesbank Hessen-Thüringen (Helaba).

Udo Henkelmann



Der gelernte Bankkaufmann und studierte Diplom-Kaufmann begann seine berufliche Laufbahn 1997 als Revisor im Dresdner Bank-Konzern. Innerhalb des Konzerns wechselte er im Jahr 2000 nach Wien und ging 2001 als Head of Operations nach Dublin. Nach seiner Rückkehr nach Frankfurt übernahm der 37-Jährige 2003 die Position als Global Head of Audit Projects für die Geschäftsbereiche Corporates und Investment Banking im Bereich IT und Operations innerhalb der Konzernrevision der Dresdner Bank. Anschließend war Henkelmann im Projekt „Payments and Settlements“ maßgeblich an der Entwicklung einer Outsourcinglösung für die internationalen Private Banking-Einheiten beteiligt. 2005 wechselte Udo Henkelmann zur Xchanging Transaction Bank GmbH, einem Spezialisten für Wertpapierabwicklung. Dort war er zunächst als Stellvertreter des CRO mit allen regulatorischen Fragestellungen betraut und übernahm 2006 die Leitung des Risikomanagements, um die Anforderungen der MaRisk sowie der SolV umzusetzen. Der Finanzdienstleister ist eines von fünf deutschen Instituten, das in 2007 die Zulassung zur Anwendung des AMA erhielt.

Seminarinhalt MaRisk – Umsetzung u...

TAG 1

Ihr Referent: Dr. Alexander Suyter

→ Aufsichtsrechtliche Normen

- Gesetzliche Vorgaben
- Normen der Bankenaufsicht
- Zusammenspiel MaH, MaK, MaIR
- Aufsichtsrechtliche Begriffsabgrenzung bei der Risiko-identifikation

→ MaRisk als Umsetzung internationaler Entwicklungen

- Baseler Prinzipien zu den verschiedenen Risikoarten
- Basel II: Qualitative Bankenaufsicht (Säule II)
- Europäische Leitlinien (ICAAP, SREP)
- Struktur der MaRisk
 - Allgemeiner Teil
 - Besonderer Teil

→ Inhalte und Umsetzung der MaRisk

- Anwendungsbereich
- Gesamtverantwortung der Geschäftsleitung
- Allgemeine Anforderungen an das Risikomanagement
 - Risikotragfähigkeit, Risikoszenarien, Risikostrategie
 - Organisation des Risikomanagements (Aufbau- und Ablauforganisation, Risikosteuerungs- und Controllingprozesse)
 - Interne Revision

→ Risikosteuerung und -controllingprozesse allgemein

- Organisatorischer Rahmen (Aufbauorganisation)
- Identifizierung, Beurteilung, Steuerung, Überwachung, Kommunikation der Risiken
- Adressausfallrisiken

→ Kreditgeschäft: Aufbauorganisation und Prozesse

- Organisation
- Funktionstrennung
- Markt, Marktfolge, Votierung
- Kreditprozesse
 - Kreditgewährung
 - Kreditweiterbearbeitung
 - Intensivbetreuung
 - Sanierung
 - Abwicklung
 - Risikovorsorge
- Risikofrüherkennung
- Beispiele für die Umsetzung

→ Risikomanagement des Adressausfallrisikos

- Management Adressausfallrisiko
- Risikoklassifizierung, Risikolimitierung
- Risikoadjustiertes Pricing

→ Risikosteuerung und -überwachung des Adressausfallrisikos

- Aufsichtsrechtliche Restriktionen: Eigenkapitalberechnung gemäß Basel II für verschiedene Kundengruppen unter Berücksichtigung verschiedener Sicherheiten
- Einbettung in die Risikotragfähigkeit
- Risikoszenarien
- Verknüpfung zur Risikostrategie



Fax: 0211 - 9686-4040



www.iir.de

→ Rahmenbedingungen

- Aufbauorganisation
- Organisationsrichtlinien, Risikohandbuch
- Dokumentation
- Ressourcen (Personal, technisch-organisatorische Ausstattung, Notfallkonzept)
- Neuprodukt- und Neue-Märkte-Prozess (MaH, MaK)
- Outsourcing
- Beispiele für die Umsetzung

Seminarzeit von 9:30 bis ca. 17:30 Uhr

TAG 2

→ Internes Kontrollsystem (IKS)

- Prinzipien
- Besondere Anforderungen an das IKS

→ Ausgestaltung der Internen Revision

- Aufgaben und Grundsätze
- Prüfungsdurchführung
- Outsourcing
- Konzernrevision
- Zusätzliche Aufgaben der Internen Revision aus den MaRisk
- Risikoorientierte Prüfungsplanung
- System-, Verfahrens-, Ablaufprüfungen

→ Beurteilung der MaRisk durch den Abschlussprüfer

→ Zeitplan und Fazit

Ihr Referent: Daniel Chouchane

→ Zins- und Liquiditätsrisiko – Risikomanagement in der Praxis

- Aufbau und Ablauforganisation einer modernen Treasury
- Management von Zinsänderungsrisiken in der Praxis
- Identifizierung, Beurteilung, Steuerung, Überwachung und Kommunikation der Risiken
- Management von Liquiditätsrisiken in der Praxis
- Interdependenzen zwischen den Risikoarten

Ihr Referent: Udo Henkelmann

→ Management operationeller Risiken und Anforderungen an das Outsourcing

Operationelle Risiken

- MaRisk und ihre Ausstrahlung auf die SolvV
- Ansätze zur Bestimmung des operationellen Risikos
- Organisation des Risikomanagements in der Praxis und Beispiele operationeller Verluste
- Definition Operationelle Risiken und Operationelle Verluste
- Interne Verlustdaten und die Notwendigkeit der externen Anreicherung
- Self Assessment versus Szenarioanalyse
- Frühwarnindikatoren
- Management operationeller Risiken am Beispiel
- Berichtswesen und Offenlegung
- Regulatorisches versus ökonomisches Kapital
- Vorbereitung auf die Prüfung zur Zulassung des fortgeschrittenen Messansatzes (AMA)

Outsourcing

- Neue Anforderungen an das Outsourcing
- Insourcing versus Weiterverlagerung
- Management des Outsourcings in der Praxis
- Datenschutz

Seminarzeit von 9:00 bis ca. 17:00 Uhr



IFF



DATEN ZUM SEMINAR

05. – 06. Mai 2008, Offenbach bei Frankfurt/Main
18. – 19. August 2008, Frankfurt/Main

TEILNAHMEGEBÜHR

€ 1.895,- p.P. (zzgl. gesetzl. MwSt.)



ERGÄNZENDE SEMINARE

Pricing und Modellierung von CreditRisk

07.-09. April 2008, München
22.-24. Oktober 2008, Frankfurt/Main
www.iir.de/finanz-kredit

Von Basel II zur SolvV

18.-19. Februar 2008, Frankfurt/Main
09.-10. April, München
www.iir.de/basel



INHOUSE TRAINING INHOUSE TRAINING

Sichern Sie sich Individualität durch Inhouse-Schulungen

Mit der IFF-Inhouse-Schulung ermöglichen wir Ihnen die maßgeschneiderte Gestaltung Ihres Kurses. Sie bestimmen die Schwerpunkte – wir entwickeln das Seminar, speziell zugeschnitten auf Ihre Anforderungen nach Inhalt, Zeit und Ort.

Für weitere Informationen wenden Sie sich bitte an:

Hélène Seier, Telefon: 069 - 244 327-3072

E-Mail: helene.seier@iir.de

ÜBER UNS

IIR deutschland

KONGRESSE & SEMINARE

Mit derzeit über 200 Mitarbeitern, 14 spezialisierten Geschäftsbereichen und rund 2000 Veranstaltungen jährlich ist IIR Deutschland einer der führenden Kongress- und Seminar-Anbieter.

Mehr als 500.000 Kunden setzen seit nahezu 20 Jahren auf unsere Qualität.

Über aktuellste Inhalte, unbedingten Praxisbezug, kompetenteste Referenten und Trainer, perfekte Organisation und optimalen Service vermitteln wir unseren Teilnehmern einen wirklichen und nachhaltigen Mehrwert.

Konsequente Kunden- und Marktorientierung – dafür steht IIR Deutschland.



Die „International Faculty of Finance“ ist spezialisiert auf Seminare und Kongresse zu Finanzthemen. Praxisnahe Schulung steht ebenso im Vordergrund wie umfassende Information über aktuelle Trends und Strategien.



Tel.: 0211 - 9686-3467



anmeldung@iir.de

Bitte ausfüllen und faxen!
0211 - 9686-4040

3 Gründe für den Besuch des Seminars

1. Erfahren Sie, welchen Änderungen die bestehenden Anforderungen wie MaH, MaK oder MaIR durch die neuen MaRisk ausgesetzt sind.
2. Informieren Sie sich umfassend über die verschiedenen Anforderungen, Prozesse und auftretenden Umsetzungsprobleme der MaRisk.
3. Durch den Besuch dieses Seminars können Sie sich optimal auf künftige Prüfungen vorbereiten.

Informationen zur Anmeldung

International Faculty of Finance (IFF)
Ein Geschäftsbereich der
IIR Deutschland GmbH
Postfach 11 12 34
40512 Düsseldorf
Telefon: 0211 - 9686-3467
Fax: 0211 - 9686-4040
E-Mail: anmeldung@iir.de
Internet: www.iir.de

Für Ihre inhaltlichen Fragen:
Claudia Paul, Konferenz-Managerin
E-Mail: claudia.paul@iir.de

Für Ihre Fragen:
Christina Jenewsky, Konferenz-Koordinatorin
Tel.: 0211 - 9686-3467

Stimmt Ihre Adresse?
Bitte geben Sie uns Ihre Änderungen durch:
Tel.: 0211 - 9686-3333
Fax: 0211 - 9686-4040
E-Mail: adresse@iir.de

Informationen zum Seminar

Teilnahmegebühr
Die Teilnahmegebühr beträgt € 1.895,- (zzgl. gesetzl. MwSt.). Der Preis versteht sich pro Person und beinhaltet Dokumentation, Teilnahmebestätigung, 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.

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.

05. – 06. Mai 2008 Sheraton Offenbach Hotel Am Büsing Palais Berliner Straße 111 63065 Offenbach bei Frankfurt/Main Tel.: 069 - 82999-0	18. – 19. August 2008 Hilton Frankfurt Hochstr. 4 60313 Frankfurt Tel.: 069 - 1338-0
--	---

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. gesetzl. 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 11 12 34, 40512 Düsseldorf, Tel.: 0211 - 9686-3333, E-Mail: datenschutz@iir.de und Ihre Daten werden gesperrt (weitere Infos unter www.iir.de/datenschutz.html).

Änderungen vorbehalten

Ja,

ich möchte teilnehmen:

05. – 06. Mai 2008, Offenbach bei Frankfurt/Main
 18. – 19. August 2008, Frankfurt/Main

M5113
M5197

Bitte geben Sie bei Ihrer Anmeldung unbedingt den rechts genannten Mailcode an!

1. Teilnehmer

Name	Vorname
Funktion	Abteilung/Hauspostcode
Telefon	Fax
<input type="checkbox"/> Bitte senden Sie mir zukünftig Informationen per E-Mail/Fax:	
E-Mail/Fax	Unterschrift


2. Teilnehmer

Name	Vorname
Funktion	Abteilung/Hauspostcode
Telefon	Fax
<input type="checkbox"/> 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
	Datum

MARI 18/HF