

## Geht Ihr Risikomanagement weit genug?

### Zusammenhängende Risikosteuerung im Rahmen der MaRisk und des internen Kapitalmanagements

Das Seminar befasst sich mit den Anforderungen der von der BaFin verabschiedeten MaRisk im Kontext der EU Regularien, insbesondere mit Blick auf das interne Kapitalmanagement. Die Teilnehmer erhalten einen übergreifenden Überblick zu den Regelungen der MaRisk und auch Änderungen zu den bisherigen Mindestanforderungen MaK, MaR und MaH. Im thematischen Kontext werden dabei Öffnungsklauseln und die Angemessenheit bei der Umsetzung identifiziert. Ein weiterer Schwerpunkt besteht darin, die MaRisk als Teil der nationalen Umsetzung von Basel II bzw. der EU-Eigenkapitalrichtlinien zu erfassen. Deshalb werden auch maßgebliche Aspekte der Solvabilitätsverordnung (neuer Grundsatz I) sowie des neuen Kreditwesengesetzes (KWG) diskutiert. Beispiele und Rechnungen zu zentralen Themen wie Risikotragfähigkeit und Risikoszenarien sind ebenfalls Bestandteile der Veranstaltung.

#### Inhalte

Einleitung: Aufsichtsrechtliche Normen und gesetzliche Basis; Aufsichtsrechtliche Begriffsabgrenzung bei der Risikoidentifikation. MaRisk als Umsetzung internationaler Entwicklungen: Baseler Prinzipien zu den verschiedenen Risikoarten; Basel II Säule 1 und Säule 2; Internat. Entwicklungen und EU-Richtlinien (u.a. Bankenrichtlinie, CAD III); Transformation und Zusammenhänge im deutschen Aufsichtsrecht; Das aktuelle KWG, MaRisk, Solvabilitätsverordnung SolvV (GS I neu) im Zusammenhang;

Inhalte und Umsetzung der MaRisk im Detail: Struktur und Anforderungen der MaRisk; Angemessenheit und Öffnungsklauseln; Anwendungsbereich; Gesamtverantwortung der Geschäftsleitung; Allgemeine Anforderungen an das Risikomanagement: Risikotragfähigkeit, Risikostrategie / Internes Kontrollsystem und Interne Revision / Organisatorischer Rahmen / Ressourcen (Personal, technisch-organisatorische Ausstattung, Notfallkonzept) / Neuprodukt- und Neue-Märkte-Prozess. Spezielle Anforderungen an Aufbauorganisation, Aktivitäten und Prozesse bzgl. Handelsgeschäft, Kreditgeschäft, Interne Revision und Outsourcing; Risikosteuerung und –controllingprozesse: Steuerung und Controlling der wesentlichen Risiken; Markpreissrisiko, Liquiditätsrisiko, Operationales Risiko, Adressausfallrisiko; Risikoklassifizierung MaRisk vs. Rating gemäß Basel II; Risikotragfähigkeit und Risikoszenarien; Aufsichtsrechtliche Restriktionen aus Basel/ Solvabilitätsverordnung; Methoden des Risikomanagement; Angemessenheit, Beispiele zu den einzelnen Modulen; Zeitplan und Fazit.

#### Teilnehmerkreis

Fach- und Führungskräfte aus der Risikosteuerung, Risikoüberwachung, Betriebsorganisation, Internen Revision und den Geschäftsbereichen.

Trainer	Buchungsinformationen
Dr. Alexander Suyter, RiMC Risk & Management Consultancy, München.	in Bonn Seminar-Nr. in Bonn Seminar-Nr. Gebühr:
<b>Seminare online: <a href="http://www.voeb-bildung.de">www.voeb-bildung.de</a></b>	<b>Rabattstaffel: 2. Teilnehmer 20 %, ab 3. Teilnehmer 30 % Rabatt</b>

**Veranstalter: VÖB Service GmbH, Bonn, ☎ 0228/8192-223**

**Suyter, Dr. Alexander;** 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 internationale Aufsicht gemäß Basel, EU-Richtlinien und nationale Umsetzung (u.a. SolvV, 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.

