

 **0228/8192-223**

**Senden Sie mir Seminar-Infos
in Zukunft bitte:**

per E-mail per Post

Offenes Seminarprogramm

Kathleen Weigelt
☎ 0228/8192-221
✉ bildung@voeb-service.de

Inhouse-Schulungen

Klarissa Schmidt
☎ 040/879797-15
✉ klarissa.schmidt@voeb-service.de

Zusammenhänge in den Mindestanforderungen an das Risikomanagement (MaRisk)

**Mittwoch, den 28.11.2007, 9.30 Uhr bis ca. 17.00 Uhr,
im Hause der VÖB-Service GmbH in Bonn,**
mit Dr. Alexander Suyter, Inhaber Risk & Management Consultancy, München.

Name, Vorname	Abteilung/Funktion	Preis/€*
1.		
2.		
3.		
4.		

Bitte senden Sie uns ein Angebot für eine Inhouse-Schulung zu:

Wunschtermin/Zeitfenster	
Teilnehmeranzahl	

Die Schwerpunkte von Inhouse-Schulungen werden grundsätzlich in enger Absprache zwischen Dozent und Fachabteilung fixiert.

Bitte senden Sie die Rechnung und Anmeldebestätigung bzw. das Inhouse-Angebot an:

Institut	
Anschrift	
Name/Abteilung	
Telefon/Telefax/E-mail	

*) Die Seminargebühr beinhaltet die Seminarteilnahme, Unterlagen, Erfrischungen und Mittagessen.
Die ausgewiesenen Preise berücksichtigen bei 2 Teilnehmern aus einem Institut 30 % Rabatt, ab dem 3. Teilnehmer gewähren wir 50 % Rabatt. Unsere gültigen Geschäftsbedingungen finden Sie unter www.voeb-service.de/bildung/Bedingungen.

Zusammenhänge in den MaRisk

Seminarziele

Das Seminar befasst sich mit den Anforderungen des von der BaFin verabschiedeten Rundschreibens MaRisk. Die Teilnehmer erhalten einen übergreifenden Überblick zu den Regelungen der MaRisk und auch Änderungen zu den bisherigen Mindestanforderungen MaK, MaIR 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 neuen 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.

Teilnehmerkreis

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

Referent

Dr. 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. 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.

Inhalt

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
- EU-Richtlinien (Bankenrichtlinie, CAD III)
- Transformation und Zusammenhänge im deutschen Aufsichtsrecht
- Das neue 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
- Outsourcing

Risikosteuerung und –controllingprozesse

- Steuerung und Controlling der wesentlichen Risiken
- Markpreisisiko, Liquiditätsrisiko, Operationales Risiko, Adressenausfallrisiko
- Risikoklassifizierung MaRisk vs. Rating gemäß Basel II
- Risikotragfähigkeit und Risikoszenarien
- Aufsichtsrechtliche Restriktionen aus Basel II / Solvabilitätsverordnung
- Methoden des Risikomanagement
- Angemessenheit, Beispiele zu den einzelnen Modulen

Zeitplan und Fazit