

WORKSHOP
„BASEL IV“

ECOS | FRANKFURT

ZENTRAL IN BAHNHOFSNÄHE

1 PLUS i
WORKSHOPS

„BASEL IV“: DIE FINALISIERUNG DES BASEL-III-REFORMPAKETES WORKSHOP – ÜBERBLICK UND VERTIEFUNGEN

THEMA

Rat und Parlament der Europäischen Union haben sich auf ein Gesamtpaket von Risikominderungsmaßnahmen geeinigt. Mit der Veröffentlichung des Europäischen Rates vom 15.02.2019 wurden die konkreten Änderungen an den einschlägigen aufsichtsrechtlichen Vorgaben bekanntgegeben. Diese sind Ausläufer des Basel-III-Reformpaketes, welche bisher noch nicht umgesetzt wurden. Von den Änderungen betroffen sind die Richtlinie 2013/36/EU (CRD IV) und die Verordnung Nr. 575/2013 (CRR) für die Eigenmittelanforderungen für Banken sowie die Richtlinie 2014/59/EU (BRRD) und die Verordnung Nr. 806/2014 (SRMR) für die Sanierung und Abwicklung notleidender Banken.

Mit Abschluss der Trilog-Verhandlungen werden voraussichtlich dieses Jahr die finalen Richtlinien und Verordnungen (CRD V, CRR II, BRRD II und SRMR II) vom Parlament und Rat der Europäischen Union verabschiedet. Aufgrund der Mitteilung, dass es sich nur mehr um Überarbeitungen von „Rechts- und Sprachverständigen“ handelt, gehen wir davon aus, dass die Inhalte so als final angenommen werden können. Wenngleich der zeitliche Horizont des Baseler Ausschusses bis ins Jahr 2027 hineinreicht, sind die neuen Regelungen doch deutlich früher zu implementieren, zumal aufgrund der signifikanten Änderungen in Teilen von einem hohen Implementierungsaufwand auszugehen ist.

Um Sie möglichst umfangreich über die Neuerungen und deren Effekte zu informieren, möchten wir Sie zu unserer Workshopreihe einladen, welche sämtliche Aspekte zu den Änderungen der Solvenzanforderungen aufgreift und viel Spielraum für Diskussionen vorsieht.

WORKSHOPZIELE

In den Workshops werden Ihnen die Neuerungen zukünftiger Anforderungen nähergebracht. Während unserer Veranstaltung bieten wir Ihnen ausreichend Gelegenheit zu Erfahrungsaustausch und Diskussion. Bitte teilen Sie uns zusammen mit Ihrer Anmeldung mit, welche Fragestellungen Sie besonders interessieren. Wir freuen uns auf Ihre Teilnahme und stehen im Vorfeld für Fragen gerne zur Verfügung. Da die Anzahl der Teilnehmer begrenzt ist, empfehlen wir Ihnen eine zeitnahe Anmeldung.

VERANSTALTUNGSORT

ECOS Office Center Frankfurt, Mainzer Landstraße 50, 60325 Frankfurt

1 SOLVENZANFORDERUNGEN

NEUERUNGEN AUS „BASEL IV“ IM ÜBERBLICK

Thorsten Gendrisch und Dr. Markus Rose

- Gesamtanforderung und Regelungen zum Output Floor
- Überblick und wichtige Elemente der Neuerungen für
 - Kreditrisiko
 - Neuer KSA
 - Überarbeitung des IRBA
 - Kontrahentenausfall- und CVA-Risiko
 - Marktrisiko
 - Aktuelles Umfeld und Rahmenbedingungen der Neuerungen
 - Der neue Standardansatz zum Marktrisiko
 - Operationelles Risiko
- Sonst. relevante Neuerungen durch „Basel IV“ und CRR II

Termin: Donnerstag, 16. Mai 2019

3 MARKTRISIKO

„FRTB“

Thorsten Gendrisch, Matthias Hetmanczyk-Timm und Jochen Kayser

- Übersicht über die FRTB
- Handelsbuchabgrenzung, interner Risikotransfer, Umwidmung, Handelstische
- Standardansatz (Regelungen und Beispielrechnungen)
 - Sensitivitätsbasierte Methode (Themenschwerpunkt des Workshops)
 - Sensitivitäten Delta, Vega, Curvature
 - Aggregationsverfahren
- Unterlegung des Ausfallrisikos
- Unterlegung des Residualrisikos
- Optional: Überblick über die Anforderungen an die Verwendung interner Modelle

Termin: Dienstag, 28. Mai 2019

5 ANFORDERUNGEN AN DAS ZUSAMMENSPIEL VON SÄULE 1 UND SÄULE 2

Henning Heuter

- Aktueller Stand europäischer und nationaler Anforderungen an die Risikotragfähigkeit und Umsetzungserfahrungen
- Neuer ökonomischer Ansatz der RTF
- Neuer normativer Ansatz der RTF (inkl. Beispielrechnungen)
 - Bezugsgrößen: neben P2G insb. die Kapitalgrößen der vorhergehenden Workshops
 - Grundidee: Sicherstellung der Solvenz für einen 3-Jahres-Zeitraum und in einem adversen Umfeld
- Neuerung und Integration der Sanierungsplanung

Termin: Mittwoch, 26. Juni 2019

2 KREDITRISIKO

KSA UND IRBA

Jochen Kayser und Jens Norget

- KSA
 - Einführung einer Due diligence
 - Mengengeschäft: „Regulatory retail“ und „Other retail“
 - Immobilienkredite: LTV als wesentlicher Risikotreiber
- IRBA
 - Einschränkungen Anwendungsbereich für IRB-Ansatz
 - Input-Floor
 - Übersicht über die jüngeren Entwicklungen zu den EU-Anforderungen an interne Modelle

Termin: Donnerstag, 23. Mai 2019

4 KONTRAHENTENRISIKO

SA-CCR UND CVA

Matthias Hetmanczyk-Timm und Jens Krauss

- Einordnung der Gegenparteirisiken in den Kontext der Solvenzanforderungen
- Anforderungen des neuen Standardansatzes (SA CCR) mit Beispielrechnungen
- Vereinfachungen für Institute mit wenig Derivategeschäft (Berücksichtigung des Proportionalitätsprinzips in den europäischen Regelungen)
- Das neue CVA-Rahmenwerk – Inhalte und Effekte

Termin: Mittwoch, 05. Juni 2019

ABLAUF DER WORKSHOPS

09.45 EINTREFFEN DER TEILNEHMER UND PERSÖNLICHE BEGRÜSSUNG

10.15 INHALTE DER OBIGEN AGENDA

13.00 MITTAGSPAUSE

16.45 ABSCHLUSS DES WORKSHOPS

IHRE ANMELDUNG

Anmeldung | Fax 0911 – 56 79 95 55 | Mail workshops@1plusi.de

Bitte melden Sie sich frühzeitig für die jeweilige Veranstaltung an, so dass wir Ihnen eine Teilnahme ermöglichen können. Die Kosten für die Teilnahme betragen 690 EUR pro Person zzgl. MwSt. Darin sind die Workshopunterlagen und die Verpflegung während des Workshops (Kaffeepausen, gemeinsames Fingerfood zur Mittagspause) inbegriffen. Nach Eingang des ausgefüllten Formulars erhalten Sie eine Bestätigung Ihrer Anmeldung. Bis 4 Wochen vor Veranstaltungstermin können Sie kostenlos stornieren. Nach diesem Zeitpunkt oder für den Fall, dass Sie nicht erscheinen, berechnen wir die gesamte Teilnahmegebühr. Gern aber können Sie sich von einer Kollegin oder einem Kollegen vertreten lassen. Bitte nutzen Sie für die Änderung der Anmeldung oder die Stornierung ebenfalls die genannte Faxnummer.

- ➊ SOLVENZANFORDERUNGEN:NEUERUNGEN IM ÜBERBLICK (16. Mai 2019)
- ➋ KREDITRISIKO KSA UND IRBA (23. Mai 2019)
- ➌ MARKTRISIKO „FRTB“ (28. Mai 2019)
- ➍ KONTRAHENTENRISIKO SA-CCR UND CVA (05. Juni 2019)
- ➎ ZUSAMMENSPIEL SÄULE 1 UND SÄULE 2 (26. Juni 2019)

Name mit Titel und Vorname _____

Unternehmen, Abteilung _____

Rechnungsanschrift _____

Telefon _____

Mailadresse _____

IHRE FRAGEN

Haben Sie Fragen? Wir unterstützen Sie auch gern bei Ihrer Hotelsuche, wenn Sie es wünschen. Schreiben Sie eine Nachricht oder rufen Sie uns einfach an.

UNSERE KONTAKTDATEN

1 PLUS i GmbH | Postfach 130211 | 90114 Nürnberg
T 0911 – 56 79 94 99 | F 0911 – 56 79 95 55 | www.1plusi.de