

WORKSHOPREIHE
MARISK

ECOS | FRANKFURT

ZENTRAL IN BAHNHOFSNÄHE

1 PLUS i
WORKSHOPS

UMSETZUNG DER AKTUELLEN MARISK-NOVELLE – UNSER KOMPAKTES WORKSHOPPROGRAMM

THEMA

Die fünfte MaRisk-Novelle wurde im November vergangenen Jahres veröffentlicht. Überblickartig haben wir bereits in einem Fachbeitrag über die umfangreichen Neuerungen, Spezifizierungen und Klarstellungen der jüngsten Überarbeitung berichtet. Neben den Mindestanforderungen hat die EZB gerade erst neue Leitfäden zum ICAAP und ILAAP zur Konsultation gestellt und die BaFin wird in Kürze den neuen Risikotragfähigkeitsleitfaden veröffentlichen.

Wie setzen wir den neuen normativen Ansatz um? Wie stellen wir ein angemessenes Risikomanagement für die Auslagerungen sicher? Was ist im BTR 3 für die Liquiditätsrisiken zu tun? Welche inhaltlichen und organisatorischen Herausforderungen bestehen bei der Validierung? Für die Umsetzung stehen bei vielen Häusern Projektaktivitäten an oder sind bereits gestartet. Daher haben wir für ausgewählte Themen aus den neuen Mindestanforderungen jetzt vier verschiedene Workshops zusammengestellt:

- 1 RISIKOTRAGFÄHIGKEIT/ICAAP
- 2 AUSLAGERUNGEN
- 3 LIQUIDITÄTSRISIKO
- 4 VALIDERUNG UND MODELLRISIKO

WORKSHOPZIELE

In den Workshops werden Ihnen die Neuerungen Ihrer zukünftigen 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 und beschäftigen. 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 RISIKOTRAGFÄHIGKEIT/ICAAP

Henning Heuter

- Aktueller Stand europäischer und nationaler Anforderungen an die Risikotragfähigkeit
 - Leitfaden von BaFin und Bundesbank
 - Neuer SSM-Leitfaden
- Diskussion: Stand der Dinge in der Umsetzung
- Neuer ökonomischer Ansatz
- Neuer normativer Ansatz mit Beispielrechnungen
 - Bezugsgrößen: Kapitalgrößen (Säule I) und zusätzliche Kapitalanforderungen (Säule II)
 - Grundidee: Sicherstellung der Solvenz für einen 3-Jahres-Zeitraum und in einem adversen Umfeld
- Wechselwirkungen zwischen beiden Ansätzen
- Einordnung der RTF-Entwicklungen in die MaRisk
 - Risikostrategie und -kultur
 - Anforderungen an die Datenaggregation
 - Risikoreporting

Termin: Donnerstag, 12. April 2018

3 LIQUIDITÄTSRISIKO

Henning Heuter und Tobias Würtenberger

- Überblick über die aktuellen Anforderungen
 - Neuerung in den MaRisk
 - Neuer SSM-Leitfaden
 - EBA-SREP
- Wichtige Neuerungen im BTR 3
 - Intraday-Liquidität
 - Liquiditätsablaufbilanz und Puffer: Aufbau, Herausforderungen an die Modellierung und Einsatz als Steuerungsinstrument
 - Refinanzierungsplanung
- Integrierte Betrachtung interner und regulatorischer Anforderungen
 - Unterschiedliche Definition der Liquiditätsreserve in Säule I und II
 - Einbindung der LCR-Elemente und der ALMM-Anforderungen in die Gesamtbanksteuerung

Termin: Mittwoch, 16. Mai 2018

2 AUSLAGERUNGEN

Dr. Markus Rose

- Auslagerungen im Finanzsektor: Ziele, Chancen und Risiken aus ökonomischer Sicht
- § 25b KWG und AT 9 MaRisk: Anwendungsbereich, Definition und Zulässigkeit von Auslagerungen
- Zentrale Bedeutung der Risikoanalyse
 - Elemente einer MaRisk-konformen Ausgestaltung
 - Bestimmung von nicht wesentlichen, wesentlichen und Auslagerungen von erheblicher Tragweite
- Risikomanagement von Auslagerungen – Bedeutung eines zentralen Auslagerungsmanagements
- Mindestinhalte des Auslagerungsvertrags
- Anforderungen an Vorkehrungen zur Beendigung von Auslagerungen
 - Beabsichtigte/erwartete Beendigung
 - Unbeabsichtigte/unerwartete Beendigung
- Anforderungen an Weiterverlagerungen
- Offene Fragen im Zusammenhang mit Auslagerungen

Termin: Mittwoch, 25. April 2018

4 VALIDIERUNG UND MODELLRISIKO

Dr. Walter Gruber

- Grundlagen: Nutzen und Grenzen von Modellen
- Aufsichtliche Anforderungen an Validierung und Modellrisiko
 - Validierungsanforderungen in MaRisk, CRR und SREP
 - „Typische“ Prüfungsfeststellungen
- Modellrisiko
 - Modellinventarisierung
 - Einscoren von Modellrisiken: Materialität versus Modellschwäche; Visualisierung via Heatmaps
 - Kalkulation von Risikomodellpuffern
- Einordnung der Validierungsverfahren
 - Aspekte der qualitativen Validierung: Modelldesign, Datenqualität, „Use Test“; Beispiele
 - Aspekte der quantitativen Validierung: Trennschärfe, Kalibrierung, Stabilität; Beispiele
- Konkrete Validierungsmethoden im Markt- und Kreditrisiko

Termin: Donnerstag, 17. Mai 2018

ABLAUF DER WORKSHOPS

- 10.00 EINTREFFEN DER TEILNEHMER UND PERSÖNLICHE BEGRÜSSUNG
- 10.30 INHALTE DER OBIGEN AGENDA
- 13.00 SNACK IN DER LOBBY DES VERANSTALTUNGSORTES (CA. 45 MINUTEN)
- 16.45 ABSCHLUSS DES WORKSHOPS, IM ANSCHLUSS GET TOGETHER

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 RISIKOTRAGFÄHIGKEIT/ICAAP (12. April 2018)
- ➋ AUSLAGERUNGEN (25. April 2018)
- ➌ LIQUIDITÄTSRISIKO (16. Mai 2018)
- ➍ VALIDERUNG UND MODELLRISIKO (17. Mai 2018)

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