

WORKSHOPREIHE  
SOLVENZANFORDERUNG

ECOS OFFICE-CENTER | FRANKFURT

MAINZER LANDSTRASSE 50  
60325 FRANKFURT

1 PLUS i  
WORKSHOPS

## DIE FINALISIERUNG DES BASEL III-REFORMPAKETES – UNSER KOMPAKTES WORKSHOPPROGRAMM

### THEMA

Mit der Einigung in der Sitzung am 07. Dezember 2017 hat der Baseler Ausschuss den letzten Schritt bewältigt, um die Lehren aus der Finanzmarktkrise und damit einen Schlusstrich unter langwierige Diskussionen zu ziehen. Die Verständigung über die Finalisierung des Basel III Reformpaketes, wie es von den Notenbankern bezeichnet wird, ist genaugenommen erst der Startschuss für die davon betroffenen Institute. In den nächsten Monaten werden die Umsetzungseffekte abgeschätzt und Detailplanungen initiiert. Wenngleich der zeitliche Horizont des Baseler Ausschusses bis ins Jahr 2027 hineinreicht, sind die neuen Regelungen doch deutlich früher zu implementieren. Dies ist gekoppelt an die Unsicherheit, wie die europäische Aufsicht die nächsten Schritte konkret zeitlich und inhaltlich plant. Die bereits Ende 2016 veröffentlichte Entwurfsversion zur CRR mit den Schwerpunkten im Markt- und Kontrahentenrisiko steht ebenso zur Diskussion wie die Details zur europäischen Umsetzungsvariante der im Dezember beschlossenen globalen Regelungen, bei der sicherlich das Proportionalitätsprinzip wieder eine spezielle Rolle spielen wird. Mit anderen Worten: Es bleibt spannend!

Um Sie möglichst umfangreich und gleichzeitig interessensspezifisch über die Neuerungen und deren Effekte zu informieren, möchten wir Sie gerne zu einer Workshopreihe einladen, die alle Aspekte zu den Änderungen der Solvenzanforderungen aufgreift. Die Details zu den 6 Modulen können Sie auf der nächsten Seite einsehen.

### 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

Ein Office-Center nahe HBF Frankfurt a. M. – Details werden noch bekannt gegeben

## 1 SOLVENZANFORDERUNGEN - NEUERUNGEN IM ÜBERBLICK

Thorsten Gendrisch, Dr. Markus Rose

- Gesamtanforderung und Regelungen zum Output Floor
- Überblick und wichtige Elemente der Neuerungen für
  - Kreditrisiko
  - Kontrahentenausfall- und CVA-Risiko
  - Marktrisiko
  - operationelles Risiko

Termin: Mittwoch, 21. Februar 2018

## 3 KONTRAHENTENRISIKO

Thorsten Gendrisch, Matthias Hetmanczyk-Timm,  
Jens Krauss

- Einordnung der Gegenpartearisiken 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, 07. März 2018

## 5 OPRISK

Dr. Markus Rose, Rainer Sprengel

- SMA – der neue Standardansatz zur Berechnung der Eigenmittelanforderungen für operationelle Risiken
- Operationelle Risiken in MaRisk und SREP
- Management operationeller Risiken: Kultur und Anreize
- Aufbau und Einsatz einer OpRisk-Datenbank
- Steuerung des Reputationsrisikos

Termin: Mittwoch, 21. März 2018

## 2 KREDITRISIKO KSA & IRB

Jochen Kayser, Jens Norget

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

Termin: Mittwoch, 28. Februar 2018

## 4 MARKTRISIKO

Thorsten Gendrisch, Matthias Hetmanczyk-Timm

- Einordnung der Marktrisiken in den Kontext der Solvenzanforderungen
- Änderungen bei der Abgrenzung zwischen Handels- und Bankbuch
- Skizzierung der Anforderungen an Interne Modelle
- Schwerpunkt: Eigenmittelunterlegung nach dem neuen Standardansatz – ausführliche Berechnungsbeispiele
- Vereinfachungen für Institute mit wenig Handelsbuchgeschäft (Berücksichtigung des Proportionalitätsprinzips in den europäischen Regelungen)

Termin: Mittwoch, 14. März 2018

## 6 WEITERENTWICKLUNG ICAAP

Henning Heuter

- Aktueller Stand europäischer und nationaler Anforderungen an die Risikotragfähigkeit
- Neuer ökonomischer Ansatz
- Neuer normativer Ansatz mit Beispielrechnungen
  - Bezugsgrößen: neben P2G und P2R insb. die Kapitalgrößen der vorhergehenden Workshops
  - Grundidee: Sicherstellung der Solvenz für einen 3-Jahres-Zeitraum und in einem adversen Umfeld

Termin: Donnerstag, 12. April 2018

**ABLAUF DER WORKSHOPS**

- 10.00 EINTREFFEN DER TEILNEHMER UND PERSÖNLICHE BEGRÜSSUNG
- 10.30 INHALTE ENTSPRECHEND 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](mailto: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.

- ① NEUERUNGEN IM ÜBERBLICK (21. Februar 2018)
- ② KREDITRISIKO KSA & IRB (28. Februar 2018)
- ③ KONTRAHENTENRISIKO (07. März 2018)
- ④ MARKTRISIKO (14. März 2018)
- ⑤ OPRISK (21. März 2018)
- ⑥ WEITERENTWICKLUNG ICAAP (12. April 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](http://www.1plusi.de)