

Basel III Academy

Basis- und Vertiefungswissen zur Praxis der regulatorischen Vorgaben

16. bis 18. April 2012 in Wiesbaden
18. bis 20. Juni 2012 in Mainz

vereon.ch

»»< VEREON
know-how for your success

Ihre Referenten



Prof. Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University und True North Institute

Dr. Ulrich J. Giebel
Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht

Highlights aus dem Inhalt

- Analyse des Regelwerkes in Bezug auf Liquiditätsrisiko, Kreditrisiko, Marktrisiko, Leverage Ratio und Kapitalpuffer
- Gemeinsame Steuerung von LCR und NSFR
- Aktuelle Entwicklungen bei der Beaufsichtigung des Liquiditätsrisikos
- Herausforderungen bei der Planung unter Basel III: Pricing und Risikomanagement
- Abhängigkeiten zwischen Kredit- und Liquiditätsrisiko
- Matched Funding unter LCR und NSFR
- Verbessertes Collateral Management

Basismodul: Basel III

AGENDA TAG 1

8.55

Begrüßung durch den Seminarleiter Prof. Dr. Christian Schmalz

- Organisatorisches
- Vorstellung
- Programmübersicht

9.00

Einführung Teil 1: Basel II

- Basel II Überblick
 - 3-Säulenstruktur
 - Kapitalkennziffern
 - Gesetzliche Einordnung in Deutschland
- Haupttreiber der Finanzkrise und Defizite von Basel II

10.30 Kaffeepause

10.45

Einführung Teil 2: Basel III

- Aufsichtsrechtliche Reformen 2007-2012
- Basel 2.5 und Basel III
 - Komponenten im Überblick
 - Bankenkontext
 - Zeitplan der Einführung

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.15

Marktrisiko (Basel 2.5)

- Stressed VaR
- Incremental Risk Measure (IRM)
- Verbriefungen

14.00

Kapital (Neu-)Definition

- Status Quo und Zielsetzungen
- Kapital: Qualität, Konsistenz und Transparenz

14.45 Kaffeepause

15.00

Kreditrisiko

- Systemisches Risiko: Korrelationsmultiplikator
- Kontrahentenrisiken für OTC-Derivate
 - Kontrahentenausfallrisiko
 - Exposure at Default Bestimmung
 - Kapitalunterlegung unter Basel II
 - Anpassungen unter Basel III
 - Kontrahentenmigrationsrisiko (CVA)
 - Zielsetzung
 - Standardansatz
 - Interne Modelle

17.30 Ende des ersten Tages

AGENDA TAG 2

9.00

Aktuelle Entwicklungen bei der Beaufsichtigung des Liquiditätsrisikos: Basel/Brüssel, LCR, NSFR

- Liquiditätsstandards nach Basel III:
 - Liquidity Coverage Ratio (LCR)
 - Net Stable Funding Ratio (NSFR)
- Einführung der neuen Standards: CRD IV/CRR
- Meldeanforderungen ab 2012

Dr. Ulrich J. Giebel, Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht

10.30 Kaffeepause

10.45

Leverage Ratio

- Motivation
- Komponenten
- Diskussion

11.15

Kapitalpuffer

- Kapitalerhaltungspuffer
 - Zielsetzung
 - Kapitalpuffer versus Mindestkapital
 - Wirkungsweise
- Antizyklischer Puffer
 - Zielsetzung
 - Wirkungsweise
- Puffer für systemrelevante Institute
 - Zielsetzung
 - Wirkungsweise

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.15

Liquiditätsrisiko

- Überblick
- LCR
 - Motivation und Wirkungsweise
 - Auswirkungen
 - Kalibrierung
 - Herausforderungen
- NSFR
 - Motivation und Wirkungsweise
 - Auswirkungen
 - Kalibrierung
 - Herausforderungen

14.45 Kaffeepause

15.00

Gemeinsame Steuerung von LCR und NSFR

- Anwendungsbeispiele LCR/NSFR
- Gemeinsame Darstellung von LCR und NSFR
- Regulatorisch teure/günstige Produkte
- Gemeinsame Steuerung

17.00 Ende des Basismoduls

Vertiefungsmodul: Planung unter Basel III

AGENDA TAG 3

9.00

Basel III Überblick

- Kapital
- Liquidität
- Leverage Ratio
- Kreditrisiko

10.30 Kaffeepause

10.45

Das CLEaR-Konzept zur Planung

- Komponenten
- Stresstesting, Planung und Optimierung
- Preis-Absatz-Funktionen (Volumenssensitivitäten)
- Ein exemplarisches CLEaR-Modell

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.15

Herausforderungen bei der Planung unter Basel III

- Pricing: Erhöhte Kapital- und Liquiditätskosten
 - Produktmatrix
 - Kostendeckende Produktpreise
- Risikomanagement: Nichterfüllung der Pillar 1-Kennzahlen
 - Simultane Steuerung von regulatorischen Kennziffern
 - Kosten regulatorischer Kennziffern

14.45 Kaffeepause

15.00

Basel III: Herausforderungen im Detail

- Abhängigkeiten zwischen Kredit- und Liquiditätsrisiko
- Leverage Ratio und Total Capital Ratio
- Matched Funding unter LCR/NSFR
- LCR/NSFR Asymmetrien
- Verbessertes Collateral Management

17.30 Ende des Vertiefungsmoduls

AKTUELLE VERANSTALTUNGSHINWEISE

Risikomanagement für Banken

27. und 28. März 2012, Frankfurt am Main
04. und 05. Juni 2012, Düsseldorf
www.vereon.ch/rmb

Risiko- und wertorientierte Gesamtbanksteuerung

17. und 18. April 2012, Wiesbaden
www.vereon.ch/rwb

Liquiditätsrisikomanagement unter Basel III

19. und 20. April 2012, Wiesbaden
21. und 22. Juni 2012, Mainz
www.vereon.ch/lmb

IHRE REFERENTEN



Prof. Dr. Christian Schmaltz arbeitet momentan als Assistant Professor für Finance an der Aarhus University und ist mit dem True North Institute in London affiliert. Zudem lehrt er an der Frankfurt School of Finance & Management Bank Controlling und Liquidity Risk Management und ist Autor zahlreicher Veröffentlichungen im Bereich Liquiditätsmanagement. Weiterhin

arbeitet er erfolgreich als Trainer für Risikomanagement. Vor seinem Wechsel in die Academia hat er sieben Jahre Erfahrung in der Risikomanagementberatung von Banken in Europa, im Nahen Osten und Südafrika gesammelt. Seine Projekterfahrung reicht im Bereich Marktrisiko vom Derivatepricing bis zum Setzen von Marktpreislimiten, im Liquiditätsrisiko von der Modellierung der Zahlungsströme einzelner Instrumente bis hin zu einem integrierten Liquiditätsstresstest sowie in der Kapitalsteuerung von statischer bis hin zu dynamischer Kapitalallokation.

Dr. Ulrich J. Giebel absolvierte sein Studium der Wirtschaftswissenschaften in Trier, Köln und Manchester. Er bekleidete Führungspositionen im Finanzmanagement internationaler Unternehmen im In- und Ausland und ist heute in der Grundsatzabteilung der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht u. a. für Fragen der Umsetzung von Basel III zuständig.

GUTE GRÜNDE FÜR IHRE TEILNAHME

Viele praktische Auswirkungen der Basel III-Vorgaben sind in Instituten noch nicht klar. Konkrete Herausforderungen stellen u. a. die Erfüllung der Liquiditätskennzahlen NSFR und LCR oder auch die vor kurzem durch die European Banking Authority (EBA) eingeführten Kapitalanforderungen, welche einen Großteil des Kapitalbedarfs durch Basel III bereits in 2012 vorziehen. Für europäische Banken herrscht daher akuter Handlungsbedarf, um compliant zu sein. Profitieren Sie von:

- Referenten mit hohem Forschungs- und Praxisbezug
- kompakt aufbereiteter Expertise
- wertvollen Handlungsempfehlungen aus der Praxis für die Praxis
- verschiedenen Case Studies im Rahmen der Veranstaltung

WER SOLLTE TEILNEHMEN?

Diese Veranstaltung wendet sich an Fach- und Führungskräfte von Banken, Sparkassen, Genossenschaftsbanken und anderen Finanzdienstleistungsinstituten u. a. aus den Bereichen:

- Basel II / III
- Liquiditätsmanagement
- Treasury
- Risikomanagement
- Risikocontrolling
- Kapitalplanung
- Aktiv-Passiv-Steuerung / Asset Liability Management
- Revision / Audit
- Controlling
- Meldewesen

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

Basismodul (EUR 1'895.-)

- 16. und 17. April 2012, Wiesbaden
- 18. und 19. Juni 2012, Mainz

Vertiefungsmodul (EUR 1'295.-)

- 18. April 2012, Wiesbaden
- 20. Juni 2012, Mainz

Basis- und Vertiefungsmodul (EUR 2'495.-)

- 16. bis 18. April 2012, Wiesbaden
- 18. bis 20. Juni 2012, Mainz

Die Teilnahmegebühr gilt pro Person und Termin zzgl. MwSt.

TEILNEHMER

Anrede, Titel

Name, Vorname

Position, Abteilung

E-Mail

Firma

Strasse, Nr.

Postfach

PLZ, Ort

Land

RECHNUNGSDetails

Bestellreferenz

MwSt.-Nr.

Firma

Abteilung

Strasse, Nr.

PLZ, Ort

Datum, Unterschrift

Bei Zahlung per Kreditkarte bitte ausfüllen

Karteninhaber

Kartenummer

gültig bis

Visa

Mastercard

5 WEGE ZUR ANMELDUNG

Web vereon.ch
Telefon +41 71 677 8700
Fax +41 71 677 8701
E-Mail anmeldung@vereon.ch
Post Vereon AG
Postfach 2232
8280 Kreuzlingen
Schweiz

VERANSTALTUNGSORTE

Die Veranstaltungen finden jeweils in zentraler Lage und in gehobenem Ambiente statt. Weitere Details senden wir Ihnen rechtzeitig vor den jeweiligen Terminen per E-Mail.

TEILNAHMEBEDINGUNGEN

Geltungsbereich
Diese Teilnahmebedingungen regeln das Vertragsverhältnis zwischen dem Veranstalter und dem Teilnehmer. Der Teilnehmer erkennt mit seiner Anmeldung diese Teilnahmebedingungen an. Abweichende Allgemeine Geschäftsbedingungen des Teilnehmers haben keine Gültigkeit.

Teilnahmegebühr
Die Teilnahmegebühr beinhaltet die Teilnahme für eine Person. Sie versteht sich inklusive schriftlicher Unterlagen, Mittagessen und Tagungsgetränke zzgl. MwSt. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Diese ist direkt nach Erhalt, in jedem Fall vor Eintritt in die Veranstaltung fällig.

Anmeldung
Die Anmeldung kann schriftlich via Internet, E-Mail, Fax oder per Post oder mündlich per Telefon erfolgen. Sie ist, vorbehaltlich gesetzlicher Widerrufsrechte, verbindlich. Jede Anmeldung erlangt erst durch schriftliche Bestätigung seitens des Veranstalters Gültigkeit. Die Veranstaltungsteilnahme setzt die vollständige Bezahlung der Teilnahmegebühr voraus.

Urheberrecht
Alle im Rahmen der Veranstaltungen ausgegebenen Unterlagen sowie anderweitig erworbene Artikel sind urheberrechtlich geschützt. Vervielfältigungen und anderweitige Nutzung sind schriftlich durch den Veranstalter zu genehmigen.

Rücktritt des Teilnehmers
Sollte der Teilnehmer an der Teilnahme verhindert sein, so ist er berechtigt jederzeit ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer zu benennen. Darüber hinaus ist eine vollständige Stornierung bis 30 Tage vor Beginn der Veranstaltung kostenlos möglich. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Bei späterem Rücktritt oder Nichterscheinen wird die gesamte Teilnahmegebühr fällig.

Programmänderungen und Absagen
Der Veranstalter behält sich vor, Änderungen am Inhalt des Programms sowie Ersatz und Weglassen der angekündigten Referenten vorzunehmen, wenn der Gesamtcharakter der Veranstaltung gewahrt bleibt. Muss eine Veranstaltung aus wichtigem Grund oder aufgrund höherer Gewalt (kriegerische Auseinandersetzungen, Unruhen, terroristische Bedrohungen, Naturkatastrophen, politische Beschränkungen, erhebliche Beeinflussung des Transportwesens usw.) abgesagt oder verschoben werden, so wird der Veranstalter die zu diesem Zeitpunkt angemeldeten Teilnehmer umgehend schriftlich oder mündlich benachrichtigen. Bereits eingegangene Zahlungen werden für eine zukünftige Veranstaltung gutgeschrieben oder bei einer Terminverschiebung auf den neuen Termin ausgestellt. Kosten seitens des Teilnehmers, die mit der Absage einer Veranstaltung verbunden sind (z.B. Reise- und Übernachtungskosten), werden nicht erstattet.

Haftung
Alle Veranstaltungen werden sorgfältig recherchiert, aufbereitet und durchgeführt. Sollte es dennoch zu Schadensfällen kommen, so übernimmt der Veranstalter keine Haftung für die Vollständigkeit und inhaltliche Richtigkeit in Bezug auf die Vortragsinhalte und die ausgegebenen Unterlagen.

Datenschutz
Überlassene persönliche Daten behandelt der Veranstalter in Übereinstimmung mit den geltenden datenschutzrechtlichen Bestimmungen. Sie werden zum Zwecke der Leistungserbringung elektronisch gespeichert. Einblick und Löschung der gespeicherten Daten kann jederzeit gefordert werden. Anfragen bitte per E-Mail an: info@vereon.ch.

Schlussbestimmungen
Der Vertrag unterliegt dem schweizerischen Recht. Gerichtsstand ist Kreuzlingen (Schweiz).