

Basel III · CRD IV · EMIR

Ertragsauswirkungen ermitteln, Strategien entwickeln,
Kontrahentenrisiken beherrschen

vereon.ch/bankwesen

Highlights aus dem Inhalt

Basel III / CRD IV: Herausforderungen für Institute im Detail

Analyse des Regelwerkes in Bezug auf Liquiditätsrisiko,
Kreditrisiko, Marktrisiko

Clearing mit zentralen Kontrahenten (CCPs) im Zuge der
European Market Infrastructure Regulation (EMIR)

OTC-Clearing unter EMIR

Gemeinsame Steuerung von LCR und NSFR

Herausforderungen bei der Planung unter Basel III: Pricing
und Risikomanagement

Das CLEaR-Konzept zur Planung

Basel III: Anforderungen, Ertragsauswirkungen, Strategien

18. und 19. Februar 2013, Düsseldorf

15. und 16. April 2013, Frankfurt/M.

Basel III, EMIR: Kontrahentenrisiken

20. Februar 2013, Düsseldorf

17. April 2013, Frankfurt/M.

Stimmen ehemaliger Teilnehmer

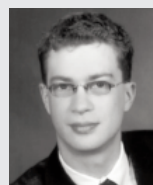
«Sehr fachkompetente Referenten, aktuell, guter Vortragsstil
und ausführliche Materialien. Sehr empfehlenswert.»

«Das Seminar bietet eine hervorragende Übersicht über die
Basel-III-Thematiken.»

Ihre Referenten



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



Dr. Jens Müller-Merbach
BHF-BANK



Patrick Deierling
Eurex Group



Basel III: Anforderungen, Ertragsauswirkungen, Strategien

AGENDA TAG 1

8.55

Begrüßung durch den Seminarleiter Prof. Dr. Christian Schmaltz

- Organisatorisches, Vorstellung und Programmübersicht

9.00

Einführung

- Basel II im Rückblick
 - 3-Säulenstruktur, Kapitalkennziffern
- Finanzkrise und Defizite von Basel II
- Reformagenda 2007-2012
- Basel 2.5 und Basel III
 - Komponenten, Bankenkontext, Auswirkungsstudien, Einführung

10.30 Kaffeepause

10.45

Marktrisiko

- Erweiterungen (Juli 2009): Stressed VaR, Incremental Risk Measure (IRM), Verbriefungen
- Fundamentale Anpassungen (Mai 2012): Handels- vs. Bankbuch, expected Shortfall, Marktliquidität, Modellrisiken, überarbeiteter Standardansatz

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.15

Kapital (Neu-) Definition

- Status Quo
- Kapital: Qualität, Konsistenz und Transparenz
- Neue Kapitalinstrumente

14.00

Leverage ('Basel I'-) Ratio

- Motivation
- Komponenten
- Diskussion

14.45 Kaffeepause

15.00

Kreditrisiko

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

16.15

Herausforderung Basel III: Knackpunkte der bankinternen Umsetzung

- Basel III als strategische Herausforderung für die Banksteuerung
 - Optimierung der Kapitalnutzung
 - Überprüfung der Geschäftsmodelle
- Basel III als operative Herausforderung für Banken
 - (Um-)Gestaltung der Aufbau- und Ablauforganisation
 - Know-How-Aufbau
- Gegenläufige Trends in der Bankenregulierung

Dr. Jens Müller-Merbach, Leiter Capital Management, BHF-BANK

17.30 Ende des ersten Tages

AGENDA TAG 2

9.00

Antizyklizität

- Expected Loss - Abschreibungen (ISFR 9)
- Kapitalerhaltungspuffer
 - Kapitalpuffer vs. Mindestkapital
 - Wirkungsweise
- Antizyklischer Puffer

Systemrelevante Institute

- Global vs. national systemrelevante Institute
- Kapitalpuffer in Abhängigkeit der Systemrelevanz

10.00

Liquiditätsrisiko

- Überblick
- LCR und NSFR
 - Motivation und Wirkungsweise, Auswirkungen, Kalibrierung
- LCR und Repos

10.30 Kaffeepause

10.45

Gemeinsame Steuerung von LCR und NSFR

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

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.15

Vier Ratios – Eine Planung: Das CLER-Konzept

- Komponenten
- Stresstesting, Planung und Optimierung
- Preis-Absatz-Funktionen (Volumenssensitivitäten)

14.45 Kaffeepause

15.00

Herausforderungen bei der Planung unter Basel III

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

16.45

Abschließende Zusammenfassung und Diskussion

17.00 Ende des zweiten Tages

Basel III, EMIR: Kontrahentenrisiken

AGENDA TAG 3

8.55

Begrüßung durch den Seminarleiter Prof. Dr. Christian Schmaltz

- Organisatorisches
- Vorstellung
- Programmübersicht

9.00

Einführung

- Handelsprozess
- Execution, Post-Trade, Clearing, Reporting, Risikomanagement
- Gegenparteiisiken
- Clearing
- Regulatorische Veränderungen (Basel III, EMIR, ..)
- Implementierungszeitplan

10.30 Kaffeepause

10.45

Clearing mit zentralem Kontrahenten / Central Counterparty (CCP) unter der European Market Infrastructure Regulation (EMIR)

- Clearing-Pflichten und -Wahlmöglichkeiten
- Settlement-Prozess über CCP
- Überblick über CCPs am Markt
- Standards für CCPs
- Zugangsstrategien
- Kostenmodelle von CCPs

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.15

OTC-Clearing unter EMIR

- Settlement-Prozess von OTC-Derivaten
- Handelsregister
- Maßnahmen zur Reduzierung von Gegenparteiisiken (CCR) und operationellen Risiken

14.00

CCP vs. OTC

- Kostenvergleich
- Risikomessung
- Risikomanagement

14.45 Kaffeepause

15.00

Pricing

- Pricing von Interbankderivaten
- Pricing von Derivaten mit Firmenkunden

16.00

Aktuelle Herausforderungen beim Clearing von Derivaten

- Clearing-Pflicht von OTC-Derivaten
- Anforderungen an CCP
- Einsatz von Transaktionsregistern

Patrick Deierling, Senior Vice President, Eurex Group

17.30 Ende des dritten Tages

IHRE REFERENTEN



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Assistant Professor für Finance an der Aarhus University und 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 sowie in 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. Jens Müller-Merbach verantwortet das Capital Management bei der BHF-BANK Aktiengesellschaft in Frankfurt und leitet dort das bankinterne Projekt zur Umsetzung der CRR. Er begann seine Karriere im Portfolio- und Risiko-Management eines Energieversorgers, wo er unter anderem als Händler an der Energiebörse EEX tätig war. 2007 wechselte er zur BHF-BANK und begleitete dort zunächst die Einführung einer Internen-Modelle-Methode nach Solvabilitätsverordnung. Herr Müller-Merbach hat verschiedene Veröffentlichungen zu den Themen Commodity Risk und Bankenaufsichtsrecht, insbesondere Basel III verfasst.



Patrick Deierling ist Senior Vice President bei Eurex. Seit 2010 ist er verantwortlich für die Bewertung von Auswirkungen regulatorischer Initiativen wie z. B. der European Market Infrastructure Regulation (EMIR) auf Eurex Clearing sowie der anschließenden Implementierung von Maßnahmen um sicherzustellen, dass Eurex Clearing diese Regelwerke erfüllt. Herr Deierling kam 1995 zur Gruppe Deutsche Börse, bei der er verschiedene Aufgaben im In- und Ausland wahrgenommen hat. Vor seiner aktuellen Tätigkeit war er für sechs Jahre als Leiter der Abteilung 'Research and Projects' bei Eurex verantwortlich für Marktanalysen und Management Reporting.

TEILNEHMERSTIMMEN

«Sehr empfehlenswert sowohl für den Einstieg als auch zur Vertiefung des Themas.»

T. Richter, Investitionsbank Berlin

«Professionals im Bereich 'Risikomanagement von Banken' werden von diesem Seminar nicht enttäuscht sein. Die Inhalte gehen weit über branchenübliche 'PowerPoint'-Beiträge hinaus.»

M. Schmidt, BMW Group

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

Basel III: Anforderungen, Ertragsauswirkungen, Strategien (EUR 1'895.-)

- 18. und 19. Februar 2013, Düsseldorf
- 15. und 16. April 2013, Frankfurt/M.

Basel III, EMIR: Kontrahentenrisiken (EUR 1'295.-)

- 20. Februar 2013, Düsseldorf
- 17. April 2013, Frankfurt/M.

Vorteilspreis bei Buchung beider Veranstaltungsmodule (EUR 2'495.-)

- 18. bis 20. Februar 2013, Düsseldorf
- 15. bis 17. April 2013, Frankfurt/M.

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

VERANSTALTUNGSORT

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 Tagungsgetränken 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).

