

WORKSHOPS „BASEL IV“
IM HERBST 2020

ECOS | FRANKFURT HbF
PARALLEL ALS ONLINE-
WORKSHOP

1 PLUS i
WORKSHOPS

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

THEMA

Mit Abschluss der Trilog-Verhandlungen und der Verabschiedung von EU-Parlament und -Rat wurden am 07. Juni 2019 die finalen Richtlinien und Verordnungen (CRD V, CRR II, BRRD II und SRMR II) über das Europäische Amtsblatt veröffentlicht. 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. Wengleich der zeitliche Horizont des Baseler Ausschusses bis ins Jahr 2028 hineinreicht, sind die neuen Regelungen doch deutlich früher zu implementieren (erstmalige Anwendung grundsätzlich ab 27.06.2019, zum Teil jedoch ab 01.01.2021 oder 30.06.2021). Aufgrund der signifikanten Änderungen ist in Teilen von einem hohen Implementierungsaufwand auszugehen. Gleichzeitig sind weitere Anpassungen im europäischen Aufsichtsrecht bereits absehbar, da sie mit dem Dokument BCBS 424 des Baseler Ausschusses (Finalisierung von Basel III) – bereits auf internationaler Ebene beschlossen wurden.

Um Sie möglichst umfangreich über die Neuerungen und deren Effekte zu informieren, möchten wir Sie zu unserer Workshop-Reihe einladen, welche sämtliche Aspekte zu den Solvenzanforderungen aufgreift und viel Zeit für Diskussionen vorsieht.

WORKSHOPZIELE

In den Workshops werden Ihnen die Neuerungen (inkl. der noch nicht in der CRR eingeflossenen Änderungen) 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 vor Ort in Frankfurt oder virtuell über unsere Online-Plattform 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
und parallel als Online-Workshop

1 SOLVENZANFORDERUNGEN NEUERUNGEN AUS „BASEL IV“ IM ÜBERBLICK Thorsten Gendrisch und Jens Norget

- 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 sowie coronabedingte Änderungen

Termin: Dienstag, 15. September 2020

3 MARKTRISIKO - „FRTB“ UND DELEGIERTE VERORDNUNG AUS DEZ. 2019 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, 29. September 2020

5 ANFORDERUNGEN AN DAS ZUSAMMENSPIEL VON SÄULE 1 UND SÄULE 2 Henning Heuter

- Überblick zu europäischen und nationalen Anforderungen an die Risikotragfähigkeit und Umsetzungserfahrungen
- Ökonomischer Ansatz der RTF
- Normativer Ansatz der RTF (inkl. Beispielrechnungen)
 - Bezugsgrößen: neben P2G insb. die Kapitalgrößen der vorhergehenden Workshops
 - Bedeutung regulatorischer Größen in der Steuerung
 - Grundidee: Sicherstellung der Solvenz für einen 3-Jahres-Zeitraum und in einem adversen Umfeld

2 KREDITRISIKO KSA UND IRBA Jochen Kayser und Jens Norget

- KSA
 - Einführung einer Due Diligence
 - Mengengeschäft: „Regulatory retail“ und „Other retail“
 - Immobilienkredite: Deutliche Änderungen der Verfahren zur Risikogewichtung
- IRBA
 - Einschränkungen des Anwendungsbereichs für IRB-Ansätze
 - Input-Floors
 - Übersicht über die jüngeren Entwicklungen zu den EU-Anforderungen an interne Modelle

Termin: Mittwoch, 23. September 2020

4 KONTRAHENTENRISIKO SA-CCR UND CVA Jens Krauss und Matthias Hetmanczyk-Timm

- Einordnung der Gegenparteiisiken 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. Oktober 2020

Termin: Mittwoch, 14. Oktober 2020

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 vor Ort im ECOS Office Center Frankfurt bzw. 590 EUR über die Online-Plattform pro Person zzgl. MwSt. Darin sind die Workshopunterlagen und vor Ort 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 SOLVENZANFORDERUNGEN IM ÜBERBLICK (15.09.2020)
- ② KREDITRISIKO KSA UND IRBA (23.09.2020)
- ③ MARKTRISIKO „FRTB“ (29.09.2020)
- ④ KONTRAHENTENRISIKO SA-CCR UND CVA (07.10.2020)
- ⑤ ZUSAMMENSPIEL SÄULE 1 UND SÄULE 2 (14.10.2020)

Name mit Titel und Vorname _____

Unternehmen, Abteilung _____

Teilnahme vor Ort / Online _____

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