

☰ **HERZLICH WILLKOMMEN – SCHÖN, DASS SIE DA SIND!**

Kundensymposium 2024

# AGENDA

Uhrzeit	THEMENBLOCK AUFSICHTSRECHT (CRR III / MaRisk)	THEMENBLOCK ESG	THEMENBLOCK BUSINESS INTELLIGENZ   KI   TRANSAKTIONSREPORTING   KRYPTO
11:00	<b>Ökonomische versus normative Risikosteuerung</b> <b>Dr. Walter Gruber (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Standards bei der ökonomischen Risikosteuerung für die verschiedenen Risikoarten</li> <li>Anforderungen an die normative Steuerung aus der Geschäftsstrategie</li> <li>Zugrundelegung von IFRS9-Standards bei der normativen Risikosteuerung</li> </ul>	<b>Integration von ESG-Risiken in die Gesamtbanksteuerung   Dr. Christian Stepanek (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Umsetzung der Anforderungen zu ESG-Risiken aus MaRisk und EBA Guidelines im Risikomanagementkreislauf</li> <li>Herausforderungen in der Risikoinventur: Definition von Risikotreibern, Untersuchung von Auswirkungen und Materialitätsbewertung</li> <li>Quantifizierung von ESG-Risiken: Interne Scoringverfahren und externe ESG-Ratings</li> </ul>	<b>Modernes Business Intelligence in Banken   Feliks Golenko, MultiBase, Matthias Hetmanczyk-Timm (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Potenzielle Anwendungsfelder von BI-Tools in Banken</li> <li>Praxisbericht: Ablösung eines bestehenden Handelsreportingsystems durch eine BI-Toollösung</li> <li>Designprozess: In sechs Schritten zu modernen Dashboards und Reports</li> </ul>
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	<b>MaRisk und EBA-Guidelines: Zinsänderungs- und Creditspreadrisiken</b> <b>Henning Heuter, Thorsten Gendrich (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Überblick über wichtige Änderungen durch die aktuellen Guidelines</li> <li>Berücksichtigung des CSRB und Besonderheiten im Vergleich zu den Credit-Spreads für die interne Risikomessung</li> <li>Ausreißertest für die ökonomische Perspektive (EVE) und die Zinsertragsperspektive (NII)</li> </ul>	<b>ESG-Regulatorik - Offenlegung und Meldewesen in Banken   David Kamm, Dr. Christian Stepanek (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Überblick und regulatorische Einordnung der Anforderungen der CRR III zu ESG-Risiken</li> <li>Neue Meldeanforderungen der CRR III zu ESG-Risiken</li> <li>Offenlegung von ESG-Risiken: Bestehende und neue Anforderungen aus der CRR III</li> </ul>	<b>Künstliche Intelligenz in der Bankenbranche   Baris Yildirim (Broadridge), Dr. Raphael Reinwald (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Formen des maschinellen Lernens, Generative Transformer Modelle</li> <li>Regulatorische Rahmenbedingungen (EU AI Act, BaFin Prinzipien, EBA DP/Report on ML for IRB models)</li> <li>Use Cases für Banken mit Live Demo — Broadridge BRx RegAI Solution</li> </ul>
14:00	<b>Neue Modelledefinition aus den MaRisk   Dr. Walter Gruber und Dr. Raphael Reinwald (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Erweiterung des Modellebegriffs aus der 7. MaRisk-Novelle: Modellkategorien</li> <li>Beispiele: KI-, automatisierte, Bepreisungs-, Cash-Flow-, Risikomodelle</li> <li>Anforderungen an die Modellegovernance und die Validierung</li> </ul>	<b>Prüfung von ESG-Risiken   Stephan Bellarz (DZ Bank AG)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Struktur und Ziele von internen und aufsichtlichen ESG-Prüfungen</li> <li>Definition von Prüfungsthemen und Schwerpunkten</li> <li>Erfahrungsbericht aus ESG-Prüfungen</li> </ul>	<b>Transaktionsreporting: EMIR Review und neue regulatorische Anforderungen</b> <b>Hendryk Braun, Alexander Voß (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>EMIR REFIT Status und EMIR 3.0</li> <li>MiFIR Review — Abkehr vom ToTV Konzept</li> <li>MMSR Änderungen und Lösungsoptionen</li> </ul>
14:45	Kaffeepause		
15:15	<b>Überarbeitung des IRBA im Kreditrisiko: Neuerungen, Methodik, Meldung   Dr. Jochen Klement, Kevin Meyer (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Selektive Anwendung des IRBA</li> <li>Wirkungsweise des Outputfloods</li> <li>IRBA-Meldeanforderungen nach CRR III</li> </ul>	<b>Integration von Klimarisiken in internen Stresstests</b> <b>Henning Heuter, Henning Schneider (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Wichtige aufsichtliche Anforderungen im Überblick</li> <li>Übergeordnete Stressteststory zur Abbildung von Klimarisiken, Definition der Szenarien und Abgrenzung des Betrachtungszeitraums</li> <li>Herausforderungen für die Ableitung der relevanten Risikofaktoren, die Parametrisierung und die laufende Anwendung im internen Stresstestkonzept</li> </ul>	<b>Krypto-Wertpapiere: Blockchain-Ökosysteme, Smart-Contracts, Tokenisierung und deren Bedeutung für die Wertpapierabwicklung   Rafael Kaaz (Cashlink GmbH), Lukas Görnert (1 PLUS i GmbH)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Distributed-Ledger-Technologien (DLT) &amp; Blockchain</li> <li>Tokenisierung und Krypto-Wertpapiere</li> <li>Regulatorische Rahmenbedingungen</li> </ul>
16:00	<b>Rückblick auf die siebte MaRisk-Novelle, Kernpunkte der achten MaRisk-Novelle und Zukunft der MaRisk   Dr. Ralf Hannemann (VÖB)</b>		

# AGENDA

Uhrzeit	THEMENBLOCK AUFSICHTSRECHT (CRR III / MaRisk)	THEMENBLOCK ESG	THEMENBLOCK BUSINESS INTELLIGENZ   KI   TRANSAKTIONSREPORTING   KRYPTO
11:00	<b>Ökonomische versus normative Risikosteuerung</b> <b>Dr. Walter Gruber (1 PLUS i GmbH)</b> Koons 1+2	<b>Integration von ESG-Risiken in die Gesamtbanksteuerung</b> <b>Dr. Christian Stepanek (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 1	<b>Modernes Business Intelligence in Banken</b> <b>Feliks Golenko, MultiBase, Matthias Hetmancyk-Timm (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 2
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	<b>MaRisk und EBA-Guidelines: Zinsänderungs- und Creditspreadrisiken  </b> <b>Henning Heuter, Thorsten Gendrisch (1 PLUS i GmbH)</b> Koons 1+2	<b>ESG-Regulatorik - Offenlegung und Meldewesen in Banken</b> <b>David Kamm, Dr. Christian Stepanek (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 1	<b>Künstliche Intelligenz in der Bankenbranche</b> <b>Baris Yildirim (Broadridge), Dr. Raphael Reinwald (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 2
14:00	<b>Neue Modelledefinition aus den MaRisk</b> <b>Dr. Walter Gruber und Dr. Raphael Reinwald (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 1	<b>Prüfung von ESG-Risiken  </b> <b>Stephan Bellarz (DZ Bank AG)</b> Koons 1+2	<b>Transaktionsreporting: EMIR Review und neue regulatorische Anforderungen</b> <b>Hendryk Braun, Alexander Voß (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 2
14:45	Kaffeepause		
15:15	<b>Überarbeitung des IRBA im Kreditrisiko: Neuerungen, Methodik, Meldung</b> <b>Dr. Jochen Klement, Kevin Meyer (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 1	<b>Integration von Klimarisiken in internen Stresstests</b> <b>Henning Heuter, Henning Schneider (1 PLUS i GmbH)</b> Koons 1+2	<b>Krypto-Wertpapiere: Blockchain-Ökosysteme, Smart-Contracts, Tokenisierung und deren Bedeutung für die Wertpapierabwicklung</b> <b>Rafael Kaaz (Cashlink GmbH), Lukas Görnert (1 PLUS i GmbH)</b> Christo 2
16:00	<b>Rückblick auf die siebte MaRisk-Novelle, Kernpunkte der achten MaRisk-Novelle und Zukunft der MaRisk   Dr. Ralf Hannemann (VÖB)</b> Koons 1+2		
16:45	Verabschiedung & Get Together		