IC nova
SOLUTIONS FOR FINANCE

Trendkonferenz

„Ertragspotenziale unter Druck: Lösungsansätze im Risikomanagement und in der Banksteuerung“

19. - 20.04.2018
in Würzburg

Umgang mit SREP **BCBS 368**

Anlagestrategien und Niedrigzins

Alternative Investments

Risikotragfähigkeit und Diversifikation

Liquiditätssteuerung

Aus dem Inhalt

- Umgang mit SREP und aktuellem Aufsichtsrecht
- Anlagestrategien und Niedrigzins
- Risikotragfähigkeit und Diversifikation
- Alternative Assetklassen
- Liquiditätssteuerung

Durch die aufsichtsrechtlichen Anforderungen der MaRisk, Basel III, der CRD IV und den SREP-Anforderungen resultiert für die Finanzinstitute ein komplexes Spannungsfeld zwischen erhöhten Kapitalunterlegungsanforderungen, dem nachhaltigen Einfluss der Niedrigzinsphase auf die Erträge und wachsenden Anforderungen an die Risikoquantifizierung und das Risikomanagement.

Im Fokus der Tagung stehen Informationen und Antworten zu diesen aktuellen Fragestellungen des Ertrags- und Risikomanagements und der Gesamtbanksteuerung für die Finanzinstitute.

Namhafte Experten stellen aus verschiedenen Blickwinkeln der Praxis Lösungsansätze zur Umsetzung der neuen aufsichtsrechtlichen Anforderungen und modernen Gesamtbanksteuerung vor.

Durch die limitierte Teilnehmerzahl wird der gezielte fachliche Austausch sowie die Diskussion der individuellen Fragestellungen der einzelnen Teilnehmer gewährleistet.

IHRE REFERENTEN

Dr. Andreas Beck, ICnova AG
Frank Blass, ICnova AG
Christoph Bleses, ICnova AG
Christopher Bliemel, DekaBank
Hendrik Funk, Münchner Bank eG
Wilfried Gerling, Münchner Bank eG
Günther Keller, Sparkassenverband Bayern
Dr. Michael Lesko, ICnova AG

IC nova
SOLUTIONS FOR FINANCE

Programm
19. April 2018

TAG 1:

09:00 – 09:15 Uhr	**Begrüßung** Dr. Andreas Beck, ICnova AG
09:15 – 10:30 Uhr	**Banksteuerung und Risikostrategie im Niedrigzinsumfeld** • Niedrigzinsumfeld und Implikationen für die Banksteuerung? • Lohnt sich Fristentransformation überhaupt noch? • Alternativen im Rahmen der Risikostrategie Dr. Andreas Beck, ICnova AG
10:30 – 11:00 Uhr	**Kaffeepause**
11:00 – 12:30 Uhr	**„Alles Risiko - oder was?“** • Zuviel Risiko ist selten gut! Zu wenig auch?! • Auf der Suche nach Performance? • Ergebnis- und Risikosteuerung im SREP-Zeitalter! Günther Keller, Sparkassenverband Bayern
12:30 – 13:30 Uhr	**Mittagesssen**
13:30 – 15:00 Uhr	**Deka Treasury-Kompass** • Einblicke in die Eigengeschäftssteuerung der Sparkassen • Strukturveränderungen und Allokationstrends • Exkurs: Regulatorische Anforderungen an die Kapitalallokation Christopher Bliemel, DekaBank
15:00 – 15:30 Uhr	**Kaffeepause**
15:30 – 17:00 Uhr	**SREP, IRRBB, BCBS 368, neue MaRisk, neue Vorgaben zur Risikotragfähigkeit - was will die Aufsicht eigentlich von uns?** • Aktuelle aufsichtsrechtliche Entwicklungen und ihre Praxis-auswirkungen • Neue Regelungen zum Zinsänderungsrisiko im Bankbuch • SREP als Nebenbedingung für aktuelle Banksteuerungsentscheidungen Frank Blass, ICnova AG
ab 18:30 Uhr	**Gemeinsame Abendveranstaltung**

IHRE REFERENTEN

Dr. Andreas Beck
ICnova AG

Frank Blass
ICnova AG

Christopher Bliemel
DekaBank

Günther Keller
Sparkassenverband Bayern

IC nova
SOLUTIONS FOR FINANCE

Programm
20. April 2018

TAG 2:

09:00 – 10:30 Uhr	**Weiterentwicklung der Steuerungssysteme im Rahmen des Zukunftsprojektes Münchner Bank 2020** • Ausgangslage und Motivation • Projektstrukturierung und Skizzierung erster theoretischer Lösungsansätze • Umsetzung in der Praxis und Darstellung einer Erfolgsbilanz Wilfried Gerling und Hendrik Funk, Münchner Bank eG
10:30 – 11:15 Uhr	**Basisrisiko: Ein wesentliches Zinsrisiko?** • Anforderungen: BCBS, EBA, MaRisk • Mechanik des Basisrisikos für verschiedene Produkte • Risikomessung und Wesentlichkeitsabschätzung Christoph Bleses, ICnova AG
11:15 – 11:45 Uhr	Kaffeepause
11:45 – 12:30 Uhr	**Ausweg aus dem Liquiditätsrisiko-Labyrinth: Ein roter Faden** • Die Vielfalt der Dimensionen des Liquiditätsrisikos in ICAAP und ILAAP • Welche Analyse/Kennzahl beantwortet welche Fragestellung? • Überblick über die Rahmenkonzeption Christoph Bleses, ICnova AG
12:30 – 13:30 Uhr	Mittagessen
13:30 – 15:00 Uhr	**Diskussion von Assetklassen und Anlagestrategien im Niedrigzinsumfeld** • Alternative Assetklassen im Niedrigzinsumfeld • Spreadrisikoklassen (High Yield, Emerging Markets), Währungen, weitere Assetklassen und Strategien in Diskussion • Chancen und Risiken der neuen Klassen Dr. Michael Lesko, ICnova AG
ca. 15:00 Uhr	**Abschlussdiskussion und Ende der Veranstaltung**

Dr. Michael Lesko
ICnova AG

Christoph Bleses
ICnova AG

Wilfried Gerling
Münchner Bank eG

Hendrik Funk
Münchner Bank eG

IC nova
SOLUTIONS FOR FINANCE

Anmeldung

FAX: +49 (0) 721 / 464 72 33 - 9

Teilnahmekosten

960,- EUR zzgl. MwSt. inkl. Tagungsunterlagen, Verpflegung und Abendveranstaltung

Veranstaltungsort

Schloss Steinburg
Hotel und Weinrestaurant e.K.
Mittlerer Steinbergweg 100
97080 Würzburg

Tel.: 0931 970-20
Fax: 0931 971-21
www.steinburg.com

Anfahrt

Eine detaillierte Anfahrtsbeschreibung steht unter www.steinburg.com zum Download bereit.

Wichtiger Hinweis:
Für Navigationsgeräte: „Steinburgstraße“ oder „Reußenweg 2“ eingeben!

Anmeldung

ICnova AG
An der RaumFabrik 33c
76227 Karlsruhe

Telefon: 0721 4647233–0
Telefax: 0721 4647233–9

E-Mail:
seminare@icnova.de

Internet:
www.icnova.de

FAX: +49 (0) 721 / 464 72 33 - 9

Trendkonferenz
„Ertragspotenziale unter Druck: Lösungsansätze im Risikomanagement und in der Banksteuerung“

am 19. - 20. April 2018 in Würzburg

Name, Vorname:

Abteilung:

Telefon, E-Mail:

Institut:

Straße:

PLZ, Ort:

Übernachtung von / bis:

Die Übernachtung im Einzelzimmer kostet 128,- EUR inkl. MwSt. und Frühstück.
Im Doppelzimmer zur Einzelnutzung 158,- EUR inkl. MwSt. und Frühstück.
Bitte rechnen Sie bei Abreise direkt mit dem Hotel ab.

Wichtiger Hinweis: Zimmer zu diesen Konditionen stehen unseren Kunden bis einschließlich 21.02.2018 zur Verfügung, eine spätere Reservierung ist nur auf Anfrage möglich und kann nicht garantiert werden.

Datum, Unterschrift: