

Basel II



Banken

SeminarDuo

Aktueller
Stand
Basel III

MMag. SCHÜTZ
BM für Finanzen



Mag. LEMBECK-KAPFER, LL.M.
Finanzmarktaufsicht



MMag. SEIFERT
Senior Manager ZEB



MMag. UNTEREGGER, MBA
OeNB



Mag. (FH) SCHARNER
OeNB



Seminar I BWG, FMA-VO

Seminar II Aufsichtliches Überprüfungsverfahren,
ICAAP, OpRisk

Seminare auch einzeln buchbar!



ARS
AKADEMIE
FÜR RECHT,
STEUERN &
WIRTSCHAFT

Von den Besten lernen.

IHR NUTZEN

Die Umsetzung der EU-Richtlinien zu „Basel II“ brachte bzw. bringt nach wie vor wesentliche Änderungen für die Kreditwirtschaft, die sich nicht nur auf neue Kapitalvorschriften für Banken beschränken.

Die Stärkung des Risikomanagements, aber auch die Aufsichtskonvergenz in Europa sind jene Bausteine, die das „3-Säulen-Konzept“ von Basel II zu einem Gesamtbauwerk weiterentwickeln. Nunmehr wird die Umsetzung von Basel III zu weitreichenden Änderungen mit Auswirkungen auf das Bankgeschäft führen.

REFERENTEN

MMag. Melitta Schütz (Seminar I)

BMF, spezialisiert auf Bankaufsichtsrecht, insb. Basel II und Basel III; aktuell Delegationsleiterin in den Basel-III-Verhandlungen; Ko-Autorin u.a. des Kommentars zum Bankwesengesetz (Manz-Verlag).

Mag. Eva-Désirée Lembeck-Kapfer, LL.M. (Seminar I + II)

Stv. Leiterin der Abteilung Consolidating Supervision und Aufsichtsstandards in der FMA, verantwortlich für die Umsetzung von Basel II, maßgebliche Mitarbeit an Basel-II-relevanten Verordnungen; FMA-Vertretung in EU- und EBA-Gremien im Rahmen Weiterentwicklung der CRD & CAD (CRD III, Basel III, technische Standards der EBA).

WER MUSS INFORMIERT SEIN

- ✓ *BankmitarbeiterInnen in den Bereichen Recht, Rechnungslegung, Kredit, Meldewesen, Risikomanagement, Group Reporting, Special Service Desk*
- ✓ *MitarbeiterInnen der Internen Revision, Verbandsrevisoren*
- ✓ *Beratende Berufe, WirtschaftsprüferInnen*

SEMINARINHALTE

09.00–12.30

MMag. Schütz

■ **Basel II – Einführung und Überblick**

- Die drei Säulen von Basel II
- Ordnungsnormen
- Sorgfaltspflichten
- Offenlegungspflichten
- Aufsichtskonvergenz in der EU
- Aktuelle Umsetzungen (CRD 2, 3 etc.)

■ **Basel III/CRD 4 – aktueller Stand**

- Zeitplan
- Eigenmittel
- Liquidität
- Kapitalpuffer
- EU-Verhandlungen/nationale Umsetzung

13.30–17.00

Mag. Lembeck-Kapfer, LL.M.

■ **Mindesteigenmittelerfordernis und Eigenmittel: Die Umsetzung der Säule I in den Verordnungen der FMA**

- Solvabilitätsverordnung
- Offenlegungsverordnung
- Mapping-Verordnung
- Neuerungen durch CRD III und CRD IV

■ **Säule 2 der Aufsicht – SREP (Supervisory Review and Evaluation Process)**

- Grundkonzeption
- Neuerungen durch CRD II und CRD IV

IHR NUTZEN

Basel II beschränkt sich in den Banken nicht nur auf das unmittelbare Umsetzungsteam – die aktuellen BWG-Bestimmungen und FMA-Verordnungen tangieren nahezu alle Bereiche in einer Bank und es gilt die geschäftspolitisch richtigen Entscheidungen zu treffen.

Mit besonderer Spannung werden aktuell u.a. die Entwicklungen betreffend Basel III verfolgt. Bleiben Sie am Ball und informieren Sie sich aus erster Hand!

REFERENTEN

Mag. (FH) Bernhard Scharner (Seminar II)

Seit 2007 Oesterreichische Nationalbank, Abteilung Bankenrevision; als Senior Examiner für die Vor-Ort-Leitung eines Prüfteams bei kleinen und mittelständischen österreichischen Banken verantwortlich, Prüfungsschwerpunkt: ICAAP/Gesamtbankrisikosteuerung, Marktrisiko und Liquiditätsrisiko.

MMag. Markus Seifert (Seminar II)

Seit Oktober 2011 Senior Manager bei ZEB, davor neun Jahre bei Deloitte in der FSI Advisory. Beratungsschwerpunkte: ICAAP/Gesamtbankrisikosteuerung, Liquiditätsrisikomanagement, Basel II/III Beratung, Asset-Liability-Management, Regulatory Advisory. Leitung von ICAAP-Projekten für verschiedene österreichischen Banken.

MMag. Stefan Unteregger, MBA (Seminar II)

Seit 2003 Oesterreichische Nationalbank, Bereich Bankenrevision, betraut mit der Durchführung von Bankprüfungen, Mitwirkung bei der Begutachtung von Risikomanagementmodellen; davor einige Jahre in der IT-Branche im Bankenbereich tätig; Mitarbeit in der Arbeitsgruppe OpRisk bei der Umsetzung von Basel II im österreichischen BWG, Mitglied der Subgroup on Operational Risk, Mitautor des Leitfadens zum Thema operationelle Risiken.

SEMINARINHALTE

09.00–11.15 Mag. Lembeck-Kapfer, LL.M., Mag. (FH) Scharner

■ Säule 2 – das aufsichtliche Überprüfungsverfahren

- Anforderungen an Kreditinstitute: Internal Capital Adequacy Assessment Process (ICAAP)
- Anforderungen an die Aufsicht: Supervisory Review and Evaluation Process (SREP)
- Umsetzung des ICAAP in der Praxis

11.15–13.00

MMag. Seifert

■ Umsetzung des ICAAP in der Praxis

- Praktische Umsetzungshürden und konzeptionelle Schwachpunkte – Diskussion anhand der wesentlichen Bausteine eines ICAAP
- Projektaufbau und Projektschritte zur Umsetzung eines ICAAP sowie Darstellung wesentlicher Projektrisiken
- ICAAP-Umsetzung in Anwendung des Proportionalitätsprinzips – große und kleine Institute im Vergleich
- Auswirkungen der Finanzmarktkrise auf das ICAAP-Konzept und Erweiterungen durch Basel III

14.00–16.30

MMag. Unteregger, MBA

■ Operationelles Risiko – „neue“ Kategorie, „altes“ Thema

- Detailbetrachtung der OpRisk-Bestimmungen in BWG und SolvaVO
- Aktuelle internationale Entwicklungen
- Operationelle Risiken in der Praxis
- Management operationeller Risiken
- OpRisk für kleine und mittlere Kreditinstitute

TERMINE / VERANSTALTUNGORT

Seminar I 14. Mai 2012

ARS Seminarzentrum, Schallautzerstraße 2-4, 1010 Wien

19. November 2012

ARS Seminarzentrum, Schallautzerstraße 2-4, 1010 Wien

Seminar II 15. Mai 2012

ARS Seminarzentrum, Schallautzerstraße 2-4, 1010 Wien

20. November 2012

ARS Seminarzentrum, Schallautzerstraße 2-4, 1010 Wien

Uhrzeit 9.00-17.00 Uhr (Seminar I) | 9.00-16.30 Uhr (Seminar II)

Gebühr je € 450,-

inkl. Seminarunterlagen, Begrüßungskaffee, Erfrischungsgetränken, Mittagessen und exkl. 20 % USt. Anmeldungen werden in der Reihenfolge des Eintreffens und nach Maßgabe freier Plätze berücksichtigt. Wir ersuchen Sie, nach Erhalt der Rechnung die Teilnahmegebühr bis zum Seminartermin zu überweisen.

ERMÄSSIGUNGEN

10 % (per TN) ab 3 TeilnehmerInnen eines Unternehmens

30 % (per TN) ab 10 TeilnehmerInnen eines Unternehmens

20 %* für RA-KonzipientInnen, WT-BerufsanwärterInnen, NO-KandidatInnen

10 % Ermäßigung bei Buchung beider Seminare!

*Ermäßigung nur gegen Vorlage von Legitimation/Bescheid. Ermäßigungen sind nicht addierbar!

STORNO

Bitte haben Sie Verständnis, dass bei Stornierungen ab 14 Tage vor Seminarbeginn 50 % des Seminarbetrages, bei Stornierungen oder Nichterscheinen am Veranstaltungstag die volle Gebühr in Rechnung gestellt wird. Bei jeder Stornierung beträgt die Bearbeitungsgebühr € 40,-. Bei einer Umbuchung auf einen Folgetermin bleibt die ursprüngliche Rechnung inkl. der Fälligkeit gültig. Zusätzlich wird eine Gebühr von € 20,- exkl. USt. (ausgenommen am Seminartag: 15 % Aufschlag) in Rechnung gestellt. Stornierungen können ausschließlich schriftlich entgegengenommen werden! Selbstverständlich können Sie jedoch gerne eine Ersatzperson nominieren. Die Veranstalter behalten sich vor, Seminare aus wichtigen Gründen zu verschieben sowie Programmänderungen vorzunehmen.

ANMELDUNG

+43 1 713 80 24-14

+43 1 713 80 24-26

office@ars.at

INFORMATION

Projektorganisation: Christine Walser

Inhalt / Konzeption: Mag. Almut Schwaiger

ANMELDUNG/UNTERLAGENBESTELLUNG

Ja, ich melde mich an für das Seminar „Basel II – BWG, FMA-VO“

Ja, ich melde mich an für das Seminar „Basel II – Aufsichtliches Überprüfungsverfahren, ICAAP, OpRisk“

Ja, ich bestelle per Nachnahme die Seminarunterlage zu 40 % des Seminarbeitrages, da ich an der Teilnahme verhindert bin.

Seminarunterlagen können nicht retourniert werden!

... und bin einverstanden, dass meine Daten elektronisch gespeichert werden und ich per Fax/E-Mail über weitere Veranstaltungen informiert werde. Als Gerichtsstand wird Wien vereinbart.

1. TEILNEHMER/IN

KonzipientIn BerufsanwärterIn

Name / Vorname / Titel

Aufgabenbereich / Abteilung

Tel.

Fax

E-Mail

2. TEILNEHMER/IN

KonzipientIn BerufsanwärterIn

Name / Vorname / Titel

Aufgabenbereich / Abteilung

Tel.

Fax

E-Mail

FIRMA

Beschäftigte bis 100 100-200 über 200

Branche/ Firma

Straße, Postfach

PLZ, Ort

Datum

Unterschrift