

aktuell – praxisnah – umsetzungsorientiert

Operationelle Risiken

Die Erfolgsfaktoren für ein dauerhaft erfolgreiches OpRisk Management

So haben Sie Ihre operationellen Risiken jederzeit im Griff:

- ◆ Aktuelle regulatorische Anforderungen und Empfehlungen des Fachgremiums OpRisk
- ◆ Praxiserprobte Lösungsansätze für die Messung, Quantifizierung und Steuerung operationeller Risiken
- ◆ Modelle und Berechnungsmethoden zur angemessenen Unterlegung operationeller Risiken mit Eigenkapital
- ◆ Ansätze zur prüfungssicheren Integration des OpRisk-Managements in Gesamtbanksteuerung und bankweites Risikomanagement
- ◆ Identifizierung und Bewertung von Reputationsrisiken und Einbindung in das OpRisk-Management
- ◆ Praxiserfahrungen aus AMA-Implementierung und -Abnahme
- ◆ Erkenntnisse über die aktuellen Änderungen des §25c KWG und die Schnittstelle zum OpRisk

Ihr PLUS:

- ✓ Zwei exklusive Praxisberichte von Helaba und dwpbank!
- ✓ Erfahrungsbericht zu Stärken und Schwächen des AMA!
- ✓ Aktuelle Anforderungen an das OpRisk-Management aus regulatorischer Sicht!

Ihre OpRisk-Experten:



Stefan Gramlich
Helaba Landesbank
Hessen-Thüringen



Michael Kuchenbrod
dwp-bank – Deutsche
WertpapierService Bank AG



Dr. Andreas Peter
Dr. Peter & Company AG



Markus Quick
Dr. Peter & Company AG



Karsten Stickelmann
Deutsche Bundesbank
Zentrale



Stefan Wieland
Business Integrity
Management GmbH

Bitte wählen Sie Ihren Termin:

22. und 23. August 2011 in Frankfurt/M.

26. und 27. September 2011 in Köln

Hoher Lernerfolg durch
begrenzte Teilnehmerzahl!


MANAGEMENTCIRCLE®
BILDUNG FÜR DIE BESTEN

Melden Sie sich jetzt an! Telefon-Hotline: 0 61 96/47 22-700

Aktuelle Anforderungen an Messung, Quantifizierung und Management operationeller Risiken



Ihr Seminarleiter:
Markus Quick, Senior Manager, **Dr. Peter & Company AG**, Frankfurt/M.

Inklusive der
aktuellen regulatorischen
Anforderungen!

Empfang mit Kaffee und Tee, Ausgabe der Seminarunterlagen **ab 8.45 Uhr**

9.30 Herzlich willkommen

- Begrüßung der Teilnehmer
- Kurze Vorstellungsrunde
- Darstellung der Themen und Zielsetzung des Seminars
- Abgleich mit Ihren Erwartungen

9.45 Operationelle Risiken und aktuelle Anforderungen an das OpRisk-Management aus regulatorischer Sicht

- Ansätze zur Berechnung der regulatorischen Eigenmittel
- AMA-Modelle im regulatorischen Abnahmeprozess
- SIGOR: Aktuelle Konsultationspapiere und quantitative Auswirkungsstudien
- Von CEBS zur EBA: Neue Herausforderungen auf europäischer Ebene?
- Das Fachgremium Operationelle Risiken: Funktionsweise und Empfehlungen



Karsten Stickelmann
Bundesbankdirektor, Zentralbereich
Banken und Finanzaufsicht,
Deutsche Bundesbank Zentrale,
Frankfurt/M.

10.45 Kaffee- und Teepause

11.00 OpRisk Management 2011 – aktuelle Herausforderungen in der praktischen Umsetzung

- Das OpRisk Methodenset: Wie können die eingesetzten Methoden den optimalen Nutzen erzeugen?
- Use-Test: Wie funktioniert die Umsetzung von der Theorie in die Praxis erfolgreich?
- Quantifizierung von OpRisk jenseits des AMA: Aufwand vs. Nutzen
- Vorstellung und Bewertung von Angeboten für die Erweiterung der internen Ansätze: Schadensfallkonsortien, Datenlieferanten etc.
- „OpRisk-Marketing“: Wie kann das Thema dauerhaft im Institut verankert werden (und bleiben)?

Markus Quick

12.30 Business Lunch

13.45 Umsetzung der aktuellen MaRisk Anforderungen im Hinblick auf die Risikoart OpRisk

Für die verschiedenen EK-Unterlegungsansätze werden insbesondere folgende Fragen beleuchtet:

- Wie können Stresstests für OpRisk konzipiert und durchgeführt werden?
- Wie werden Risikokonzentrationen im OpRisk identifiziert und analysiert; wie ist OpRisk in die Analyse von Inter-Risikokonzentrationen einzubeziehen?
- Wie kann eine sachgerechte Berücksichtigung von OpRisk in der Risikotragfähigkeit erfolgen?



Dr. Andreas Peter
Vorstand,
Dr. Peter & Company AG,
Frankfurt/M.

15.15 Kaffee- und Teepause

15.30 Das OpRisk Management der Helaba

- Erfolgsfaktoren für den erfolgreichen Einsatz der Methoden und Instrumente
- Vernetzung und Kommunikation als zentrale Voraussetzungen für ein dauerhaft erfolgreiches OpRisk Management
- OpRisk Reporting: Schaffung von Transparenz und Basis für die Steuerung der Risiken
- OpRisk als Bestandteil der Banksteuerung



Stefan Gramlich
Leiter Operationelle Risiken und
strategisches IT-Controlling,
Helaba Landesbank Hessen-Thüringen,
Frankfurt/M.

17.00 Zusammenfassung der Ergebnisse und Diskussion offener Fragen

ca. 17.30 Ende des Seminars, anschließendes Get-Together

Get-Together

Ausklang des ersten Tages in informeller Runde. **Management Circle** lädt Sie zu einem kommunikativen Umtrunk ein. Entspannen Sie sich in angenehmer Atmosphäre und vertiefen Sie Ihre Gespräche mit den Referenten und Teilnehmern!



Perfekte Einbindung des OpRisk-Managements in Gesamtbanksteuerung und bankweites Risikomanagement

Ihr Seminarleiter:
Markus Quick

9.00 Es geht weiter! Überleitung zu den Themen des zweiten Tages

9.15 Erfolgreiche Implementierung und Abnahme des Advanced Measurement Approach (AMA)

- Einführung AMA: Nutzen und Vorteile
- Übersicht Pflichtelemente für einen AMA
- AMA-Modeldesign
- Technische Rahmenbedingungen
- Praxisbericht Fallstricke und kritische Aspekte einer AMA-Zulassungsprüfung



Michael Kuchenbrod
Senior-Risikomanager,
Deutsche WertpapierService Bank AG,
Frankfurt/M.



10.45 Kaffee- und Teepause

11.00 OpRisk als zentraler Bestandteil eines integrativen Risikomanagement

- Analyse der zentralen Schnittstellen von OpRisk mit ähnlich gelagerten Themen, wie
 - IKS (Internes Kontrollsystem),
 - Fraud Prevention (Compliance),
 - BCM (Business Continuity Management)
 - IT-Sicherheit
- Welcher Nutzen kann aus der Verzahnung der Themen und Methoden generiert werden?
- Praxisbeispiel: Wie kann ein erfolgreiches Projekt zur Methodenintragung aussehen?

Markus Quick

12.30 Business Lunch

13.45 Fraud Prevention und OpRisk: Wie können Compliance und Risikomanagement erfolgreich ineinander greifen?

- Der neue §25c KwG als zentrale Vorgabe
- Ableitung von Anforderungen an die Institute
- Darstellung unterschiedlicher Ansätze bei der Durchführung von Fraud-Gefährdungsanalysen
- Integration gewünscht: Wege zur Verzahnung von OpRisk und Compliance Instrumenten



Stefan Wieland
Geschäftsführer,
Business Integrity Management GmbH,
Berlin

15.15 Kaffee- und Teepause

15.30 OpRisk und Reputationsrisiken

- OpRisk und Reputationsrisiko: Ursache und Folge?
- Reputationsrisiko: Definition und Bedeutung in der Finanzdienstleistungsbranche
- Externe Anforderungen an Reputationsrisiken
- Status quo beim Management der Reputationsrisiken in der Finanzdienstleistungsbranche
- Methoden und Instrumente: Reputationsrisiken identifizieren, bewerten und steuern
- Praxisbeispiel: Herausforderungen bei der Umsetzung

Markus Quick

16.45 Zusammenfassung der Seminarergebnisse und abschließende Diskussion

ca. 17.00 Ende des Seminars

Stimmen zu Management Circle-Risikomanagement-Seminaren:

- ✓ „Komplexes Themengebiet strukturiert vermittelt!“
- ✓ „Die Praxisberichte waren super und runden die Veranstaltung ab!“
- ✓ „Sehr gute Mischung zwischen Theorie und Praxis, den aufsichtsrechtlichen Anforderungen und der Umsetzung in der Praxis!“

AUCH ALS INHOUSE TRAINING

Zu diesen und allen anderen Themen bieten wir auch **firmeninterne Schulungen** an. Ich berate Sie gerne, rufen Sie mich an.

Dirk Gollnick

Tel.: 0 61 96/47 22-646

E-Mail: gollnick@managementcircle.de

www.managementcircle.de/inhouse



Bitte beachten Sie auch unsere Veranstaltung:

Basel III

27. September 2011 in Frankfurt/M.

2. November 2011 in Frankfurt/M.

Nähere Informationen gibt Ihnen gerne **Carolina Ihrig**,
Tel.: 0 61 96/47 22-700, Fax: 0 61 96/47 22-888,
E-Mail: kundenservice@managementcircle.de

Warum dieses Seminar wichtig für Sie ist

Operationelle Risiken unterliegen als wesentliche Risikoart allen entsprechenden Anforderungen der Ende 2010 novellierten MaRisk. Nicht zuletzt dadurch sind Sie gefordert, Ihr OpRisk-Management auf den Prüfstand zu stellen und an den entscheidenden Stellen zu optimieren.

Das lernen Sie hier

Die Experten dieses Seminars zeigen Ihnen, welche **aktuellen regulatorischen Anforderungen** an Ihr Management operationeller Risiken gestellt werden, welche Probleme sich in der **Prüfungspraxis** zeigen und wie Sie diese erfolgreich lösen.

Sie erfahren,

- mit welchen **bewährten und neuen Instrumenten** und **Methoden** Sie operationelle Risiken sicher messen, quantifizieren und steuern,
- wie Sie operationelle Risiken angemessen mit **Eigenkapital** unterlegen und welche Möglichkeiten Sie haben, Eigenkapital zu reduzieren,
- wie Sie das Management **operationeller Risiken nachhaltig** und **prüfungssicher** in Ihre **Gesamtbanksteuerung** und Ihr **bankweites Risikomanagement integrieren**,
- wie Sie ein adäquates und aussagekräftiges **OpRisk-Reporting** aufsetzen und
- wie Sie im Kontext des neuen **§ 25c KWG** Compliance und Risikomanagement optimal verzahnen.

Zudem erhalten Sie konkrete Empfehlungen zur **Ausgestaltung und Weiterentwicklung des AMA-Modells** und zur **Optimierung** des OpRisk-Frameworks **bei nicht-AMA-Instituten**.

Special: Reputationsrisiken

Zudem lernen Sie, welche Bedeutung **Reputationsrisiken** für Ihr OpRisk-Management haben, wie Sie Reputationsrisiken identifizieren, messen und steuern können und welche regulatorischen Anforderungen Sie hierbei beachten müssen.

Ihr Praxis-PLUS

- Zwei ausführliche **Praxisberichte!**
- Intensiver **Erfahrungsaustausch!**
- Umfangreiche **Dokumentationsunterlagen!**

Sie haben noch Fragen?

Rufen Sie mich an oder schreiben Sie mir eine E-Mail. Gerne berate ich Sie persönlich und beantworte Ihre Fragen zur Veranstaltung.



Simon Marx

Simon Marx
Konferenz Manager
Tel.: 0 61 96/47 22-691
E-Mail: marx@managementcircle.de

Stefan Gramlich, Dipl.-Wirtschaftsingenieur, ist Leiter Operationelle Risiken und strategisches IT-Controlling der **Landesbank Hessen-Thüringen** in Frankfurt/M. und Mitglied des Arbeitskreises Operationelle Risiken des Bundesverbandes Öffentlicher Banken (VöB). Seine Tätigkeit beinhaltet u.a. den Aufbau und die kontinuierliche Weiterentwicklung des Risikomanagements für operationelle Risiken im Konzern.

Michael Kuchenbrod Senior-Risikomanager, **dwpbank – Deutsche WertpapierService Bank AG** in Frankfurt/M., legt seinen Schwerpunkt auf die quantitative Gestaltung des Risikomanagementsystems u. a. im Rahmen eines Advanced Measurement Approachs. 2009 wurde der AMA in der dwpbank implementiert und aufsichtsrechtlich abgenommen. Nach seinem Studium war er zunächst in der Gruppe Deutsche Börse tätig, leitete später in einem Vorläuferinstitut der dwpbank das Produktcontrolling und ist aktuell stellvertretender Leiter des zentralen Risikomanagements.

Dr. Andreas Peter ist seit 2003 Vorstandsvorsitzender der **Dr. Peter & Company AG** in Frankfurt/M. Der Schwerpunkt seiner Beratungstätigkeit liegt in der Konzeption und Weiterentwicklung von Risikomanagement-Systemen bei Banken, Versicherungen und Asset Management-Gesellschaften. Zuvor war er als Senior Manager im Bereich Asset- und Riskmanagement bei Cap Gemini Ernst & Young sowie als Gruppenleiter im Controlling der Zentrale der Deutsche Bank AG in Frankfurt/M. tätig.

Markus Quick ist seit über 12 Jahren als Unternehmensberater im Bereich Financial Services tätig. Er startete seine berufliche Laufbahn bei der Beratungsgesellschaft PricewaterhouseCoopers in Frankfurt. Nach einer Station als Manager bei Cap Gemini Ernst & Young ist er als Mitglied des Gründungsteams seit 2003 für die **Dr. Peter & Company AG** in Frankfurt/M. als Senior Manager tätig. Dort berät er schwerpunktmäßig Kunden aus der Finanzdienstleistungsbranche in den Themenfeldern Risk, Governance und Compliance.

Karsten Stickelmann ist als Bundesbankdirektor im Zentralbereich Banken und Finanzaufsicht der **Deutschen Bundesbank** insbesondere in den Arbeitsgebieten Bankgeschäftliche Prüfungen und Umsetzung Basel II tätig. Seit 2003 leitet er die Hauptgruppe B 33 „Marktrisiko, Operationelles Risiko, Liquiditätsrisikomodelle und IT“. Karsten Stickelmann ist Co-Chair des Fachgremiums Operationelle Risiken, Co-Chair des Fachgremiums Handelsgeschäfte und Mitglied des Arbeitskreises Bankenaufsicht. Im Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht ist er in die Arbeiten der Trading Book Group und der Standards Implementation Group on Operational Risk involviert.

Stefan Wieland Kriminaloberkommissar a.D., Certified Fraud Examiner, ist Geschäftsführer der **Business-Integrity Management GmbH** und Partner von Integrity Europe. Er unterstützt GwG-, KWG-, ZAG-, VAG- Verpflichtete bei der Umsetzung von ganzheitlichen Compliance-Strategien, bei denen sein Fokus auf der effizienten Verzahnung von Präventionsfunktionen wie z.B. bei der Bekämpfung von Geldwäsche und sonstigen strafbaren Handlungen, u.a. liegt.

3 gute Gründe, dieses Seminar zu besuchen

- Sie wollen wissen, welche **aktuellen regulatorischen Anforderungen** an Ihr OpRisk-Management gestellt werden.
- Sie wollen wissen, welche **Methoden und Instrumente** sich in der Praxis bewährt haben und an welchen Stellen Sie die **Messung, Bewertungen und Steuerung** Ihrer Operationellen Risiken optimieren können.
- Sie wollen wissen, wie Sie das **Management von Reputationsrisiken** optimal in Ihr OpRisk-Management integrieren.

Wen Sie auf diesem Seminar treffen

Das Intensiv-Seminar richtet sich an **Leiter** und an **leitende Mitarbeiter** der Bereiche **Operationelle Risiken, Risikomanagement und -controlling, Gesamtbanksteuerung, Treasury, Controlling, Revision** und **Aufsicht** aus Banken, Genossenschaftsbanken, Sparkassen und sonstigen Finanzdienstleistungsinstituten. Ebenso angesprochen sind deren **Vorstände** und **Geschäftsführer** sowie Verbandsvertreter, Wirtschaftsprüfer und Unternehmensberater, die sich mit diesem Thema befassen.

Termine und Veranstaltungsorte

22. und 23. August 2011 in Frankfurt/M.
Sheraton Frankfurt Airport Hotel & Conference Center,
Flughafen/Terminal 1, 60549 Frankfurt/M.
Tel.: 069/69 77-24 02, Fax: 069/69 77-23 51
E-Mail: reservationsfrankfurt@sheraton.com

26. und 27. September 2011 in Köln
Hotel Mondial am Dom Cologne,
Kurt-Hackenbergs-Platz 1, 50667 Köln
Tel.: 02 21/20 63-570, Fax: 02 21/20 63-527
E-Mail: h1306@accor.com

Zimmerreservierung

Für unsere Seminarteilnehmer steht im jeweiligen Tagungshotel ein begrenztes Zimmerkontingent zum Vorzugspreis zur Verfügung. Nehmen Sie die **Reservierung bitte rechtzeitig selbst direkt im Hotel** unter Berufung auf Management Circle vor. Die Anfahrtsskizze erhalten Sie zusammen mit der Anmeldebestätigung.

Mit der Deutschen Bahn ab € 99,- zur Veranstaltung.
Infos unter:

www.managementcircle.de/bahn



Über Management Circle



Als anerkannter Bildungspartner und Marktführer im deutschsprachigen Raum vermittelt Management Circle **WissensWerte** an Fach- und Führungskräfte. Mit seinen 200 Mitarbeitern und jährlich etwa 3000 Veranstaltungen sorgt das Unternehmen für berufliche Weiterbildung auf höchstem Niveau. Weitere Infos zur **Bildung für die Besten** erhalten Sie unter www.managementcircle.de

So melden Sie sich an

Bitte einfach die Anmeldung ausfüllen und möglichst bald zurücksenden oder per Fax, Telefon oder E-Mail anmelden. Sie erhalten eine Bestätigung, sofern noch Plätze frei sind – andernfalls informieren wir Sie sofort. Die Anmeldungen werden nach Reihenfolge der Eingänge berücksichtigt.

Die Teilnahmegebühr für das zweitägige Seminar beträgt inkl. Business Lunch, Erfrischungsgetränken, Get-Together und der Dokumentation € 1.895,-. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Sollten mehr als zwei Vertreter desselben Unternehmens an der Veranstaltung teilnehmen, bieten wir **ab dem dritten Teilnehmer 10% Preisnachlass**. Bis zu zwei Wochen vor Veranstaltungstermin können Sie kostenlos stornieren. Danach oder bei Nichterscheinen des Teilnehmers berechnen wir die gesamte Tagungsgebühr. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Selbstverständlich ist eine Vertretung des angemeldeten Teilnehmers möglich. Alle genannten Preise verstehen sich zzgl. der gesetzlichen MwSt.

Operationelle Risiken

Ich/Wir nehme(n) teil am:

- 22. und 23. August 2011 in Frankfurt/M.** 08-69300
- 26. und 27. September 2011 in Köln** 09-69301

1 Name/Vorname _____
Position/Abteilung _____

2 Name/Vorname _____
Position/Abteilung _____

3 Name/Vorname _____
Position/Abteilung _____

Firma _____

Straße/Postfach _____

PLZ/Ort _____

Telefon/Fax _____

@ E-Mail _____

Datum _____ Unterschrift _____

Ansprechpartner/in im Sekretariat: _____

Anmeldebestätigung bitte an: _____ Abteilung _____

Rechnung bitte an: _____ Abteilung _____

Mitarbeiter: BIS 100 100-200 200-500 500-1000 ÜBER 1000

Datenschutzhinweis

Die Management Circle AG und ihre Dienstleister (z.B. Lettershops) verwenden die bei Ihrer Anmeldung erhobenen Angaben für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen Angebote zur Weiterbildung auch von unseren Partnerunternehmen aus der Management Circle Gruppe per Post zukommen zu lassen. Unsere Kunden informieren wir außerdem telefonisch und per E-Mail über unsere interessanten Weiterbildungsangebote, die den vorher von Ihnen genutzten ähnlich sind. Sie können der Verwendung Ihrer Daten für Werbezwecke selbstverständlich jederzeit gegenüber Management Circle AG, Postfach 56 29, 65731 Eschborn, unter datenschutz@managementcircle.de oder telefonisch unter 06196/4722-500 widersprechen oder eine erteilte Einwilligung widerrufen.

Anmeldung/Kundenservice

Telefon: +49 (0) 61 96/47 22-700
Fax: +49 (0) 61 96/47 22-999
E-Mail: anmeldung@managementcircle.de
Internet: www.managementcircle.de/08-69300
Postanschrift: **Management Circle AG**
Postfach 56 29, 65731 Eschborn/Ts.
Telefonzentrale: +49 (0) 61 96/47 22-0

