

ROLAND ELLER

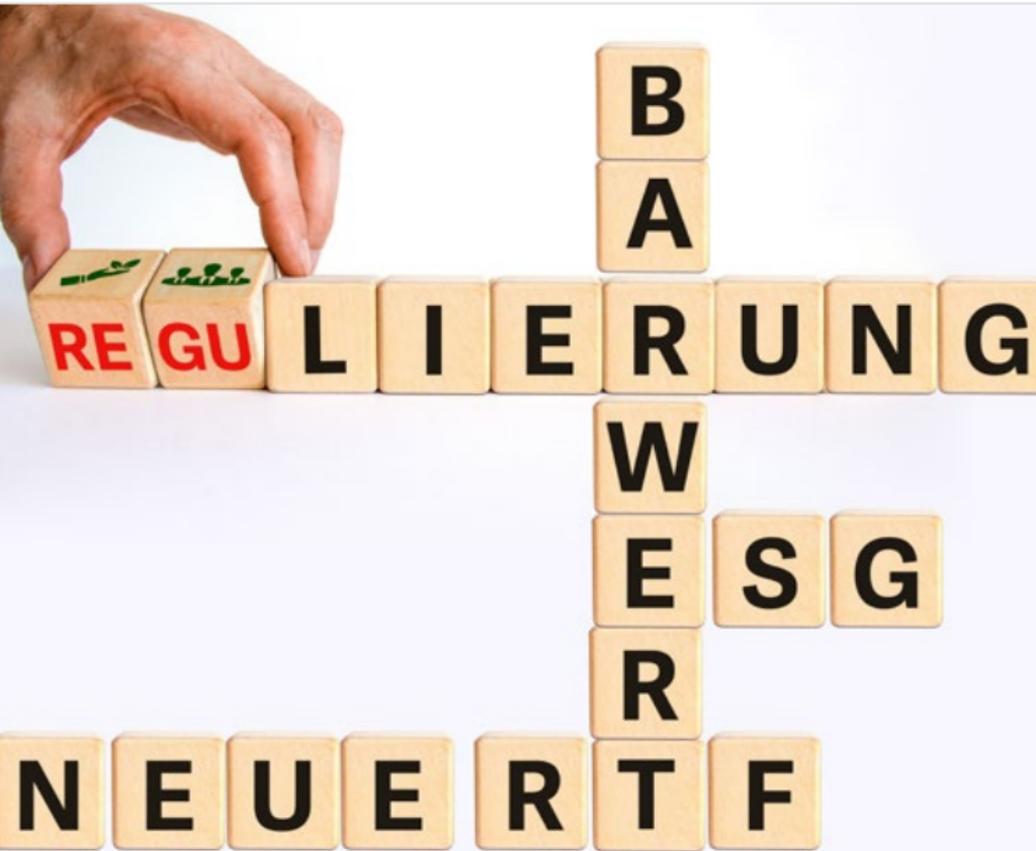
| Consulting | Training |



18. Roland Eller Vorstands-Akademie

in Zusammenarbeit mit

SCP | REAL INVESTMENT
Deutschland



Regulierung –
Neue ökonomische RTF –
Nachhaltigkeit

Präsenzveranstaltung
14./15. März 2024



Online-
Seminar

THEMEN



Die Vorstands-Akademie vermittelt die wichtigsten Regulierungsbaustellen der nächsten Jahre im Überblick, aktuelle Ergebnisse aus § 44er Prüfungen und neue Erkenntnisse zur ökonomischen Perspektive



Roland Eller

Geschäftsführer,

Roland Eller Consulting GmbH

Als Trainer und Berater begeistert er mit vielen anschaulichen Beispielen und aktivem Einbeziehen seine Zuhörer.



Detlef Schumacher

Geschäftsführer,

SCP REAL INVESTMENT DEUTSCHLAND

DER 360-Grad Spezialist und Vordenker für für Treasury/Depot-A von Banken und Sparkassen bei Investments, sowie speziell bei Immobilienfonds.

REFERENTEN



Dr. Tobias Volk

Bundesbankdirektor im Bereich Banken- und Finanzaufsicht, Deutsche Bundesbank, Frankfurt

Er ist zuständig für das Thema Risikotragfähigkeit und die internationale Koordination auf diesem Gebiet.



Dr. Sebastian Irle

*Bundesbankdirektor,
Deutsche Bundesbank*

Er ist Experte für Risikomodellierung und beurteilt als Bankenprüfer quantitative Modelle und Methoden zur Risikomesung. Seit über 10 Jahren lehrt er an der Frankfurt School of Finance.



Dominik Leichinger

Prüfungsleiter im Referat Bankgeschäftliche Prüfungen 2 in der Hauptverwaltung in NRW, Deutsche Bundesbank

Die Beurteilung der Umsetzung aufsichtsrechtlicher Anforderungen bei den Kreditinstituten gehören für ihn zum Tagesgeschäft.



Dr. Thomas Dietz

Leiter des Referats Bankgeschäftliche Prüfungen Hauptverwaltung in Berlin und Brandenburg, Deutsche Bundesbank

Er kennt die neuesten Entwicklungen bei der Aufsicht über LSI und begeistert seine Zuhörer durch seine anschauliche Sprache.

Tag 1

18. Roland Eller Vorstands-Akademie

Was kommt auf Banken und Sparkassen in den nächsten Jahren zu: Neue RTF und 7. MaRisk-Novelle

10.00 – 10.10 Uhr

Roland Eller

Begrüßung und Eröffnung der Roland Eller Vorstands-Akademie

10.10 – 11.45 Uhr

Dr. Tobias Volk

Risikotragfähigkeit 2024: Der aktuelle Stand der Dinge

- Erste Ergebnisse der RTF-Meldungen zum 31.12.2023
- Wesentliche Erkenntnisse aus Pilotprüfungen bei Instituten und Verbänden
- Europäischer Vergleich: starke Institute durch starke Aufsicht, oder?

12.00 – 13.30 Uhr

Dr. Sebastian Irle

Anforderungen an Risikomodellierung gem. der 7. MaRisk-Novelle

- Bedeutung und Einordnung des AT 4.3.5
- Sich hieraus ergebende Anforderungen an die Modellentwicklung und die Modellvalidierung
- Typische Fragestellungen:
 - Annahmen und Limitationen der Modelle
 - quantitative Begründbarkeit der getroffenen Annahmen
 - Materialität von Modellrisiken
 - Grad der statistischen Unsicherheit der Risikoschätzungen
 - (Grenzen der) Anwendbarkeit eines Verbandsmodells auf das eigene Portfolio: Bedeutung und Messung von Repräsentativität
- Illustrative Beispiele für typische Probleme bei der Risikomodellierung aus wissenschaftlicher Sicht
- Proportionalitätsgedanken & Fragen, die der Vorstand seinen Modellentwicklern und Controllern stellen sollte

anschließend Pause mit gemeinsamem Mittagessen

14.03.2024



14.30 – 16.00 Uhr

Roland Eller

Ökonomische RTF endlich verstehen – Impulse für ein besseres Verständnis der ökonomischen Sichtweise

- Auf der Suche nach dem Schatz im (Silber-)Barwertsee – Wie geht es nun weiter?
- Ein Blick unter die Wasseroberfläche: Gehen wir gemeinsam den stillen Reserven bzw. Lasten auf den Grund!
- Was zeigt der Vergleich von Buchwerten und Barwerten? Wie können Sie davon profitieren?
- Barwerte von Assetklassen und die dazugehörigen VaR-Werte: Worauf müssen Sie achten?
- Steuerungsimpulse aus der ökonomischen Perspektive – Sinn oder Unsinn?

16.15 – 17.45 Uhr

Detlef Schumacher

Immobilieninvestments vor (neuen?!) Herausforderungen

- ESG: Rechtliche Unsicherheit und praktische Herausforderungen. Was kann das Fondsmanagement leisten und mit welchen Ergebnissen wie auch Auswirkungen ist zu rechnen?
- Zinsanstieg & Immobilienrisiko vs. Immobilienertrag & Stabilität. Was kommt da noch auf die Investoren zu?
- Asset Allocation ganzheitlich neu gedacht. Wie kann **i**TREASURY in der strategischen Planung und in der Umsetzung unterstützen?

17.45 – 18.00 Uhr

Roland Eller

Diskussion und Zusammenfassung

19.00 Uhr Gemeinsames Abendessen mit Dinner Speaker Prof. Dr. Marius Kloft zum Thema KI

Tag 2 – 15.03.2024

Was kommt auf Banken und Sparkassen in den nächsten Jahren zu: Die wichtigsten Ideen der Bankenaufseher zu ESG

09.00 – 09.05 Uhr

Roland Eller

Eröffnung des 2. Tages der Roland Eller Vorstands-Akademie

09.05 – 10.40 Uhr

Dominik Leichinger

Integration der EBA-Leitlinien für die Kreditvergabe und Überwachung in die MaRisk:

- Beurteilung und Steuerung von ESG-Risiken im Kontext der Kreditprozesse
- Erweiterte Anforderungen an die Kapitaldienstfähigkeitsanalyse sowie die Kreditrisikoüberwachung

11.05 – 12.45 Uhr

Dr. Thomas Dietz

ESG-Prüfungen der Aufsicht – Was nun?

- Nachhaltigkeit als mögliches profitables Geschäftsfeld
- ESG-Anforderungen der neuen MaRisk und der CRD VI
- Erste ESG-Prüfungsergebnisse
- Notwendige Anpassungen der Prüfungsansätze?

12.45 – 13.00 Uhr

Diskussion und Zusammenfassung

Programmänderungen aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

VORTEILE

- ✓ Aktuelle aufsichtsrechtliche Themen werden praxisorientiert präsentiert
- ✓ 2-Tagesveranstaltung mit Aufsehern, Praktikern und Roland Eller für Vorstände und stellvertretende Vorstände
- ✓ Sie treffen sich mit Interessierten von regionalen Banken und Sparkassen
- ✓ Das Wesentliche auf den Punkt gebracht: Konkrete Umsetzungshilfen und Best-Practice-Beispiele
- ✓ Sie erhalten einen Überblick über den Umsetzungsstand in anderen Banken und Sparkassen

„Ein Fixpunkt in meinem jährlichen Seminarkalender und zusammen mit der Eller-ERFA ein sehr guter Baustein, um für die Umsetzung der hohen aufsichtlichen Anforderungen in unseren Häusern gut gerüstet zu sein.“

Claus Nordsieck
Vorstand, Kreissparkasse Grafschaft Diepholz

INFOS

Einladung

Die Veranstaltung richtet sich an Vorstände, stellvertretende Vorstände und Führungskräfte von Banken, Sparkassen und Genossenschaftsbanken. Jeder Teilnehmer erhält zur Bestätigung ein Teilnehmerzertifikat.

Seminarkosten (für Präsenz- und Online-Seminar)

- **Kosten:** € 1.848,- zzgl. MwSt für einen Teilnehmer bzw. € 1.648,- zzgl. MwSt für jeden weiteren Teilnehmer Ihres Hauses

14./15. März 2024, Frankfurt am Main

Veranstaltungsort

Frankfurt Marriott Hotel
Hamburger Allee 2
60486 Frankfurt am Main



Übernachungskosten

Im Hotel steht ein begrenztes Zimmerkontingent zum Vorzugspreis von 219 € (EZ) inkl. Frühstück zur Verfügung. Bitte nehmen Sie die Reservierung direkt im Hotel (Telefon: 069 7955 2222) oder über Reservierungslink, der mit der Anmeldebestätigung versendet wird, vor (Stichwort „Roland Eller“).

Leistungen und Teilnahmebedingungen

- inklusive Seminarunterlagen als pdf-Dateien, Tagungsverpflegung, Abendessen
- Teilnehmer erhalten ein Teilnehmerzertifikat
- schriftliche Stornierung bis 14 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenlos möglich, danach werden 50 % des Teilnahmebetrages erhoben
- bei Nichterscheinen oder Stornierung am Veranstaltungstag wird der gesamte Teilnahmebetrag fällig
- gern akzeptieren wir ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer
- **Anmeldung bis 30.12.2023**

INFOS

14./15. März 2024 Online-Seminar

- inklusive Seminarunterlagen als pdf-Dateien
- Teilnehmer erhalten ein Teilnehmerzertifikat
- schriftliche Stornierung bis 14 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenlos möglich, danach werden 50 % des Teilnahmebetrages erhoben
- bei Nichterscheinen oder Stornierung am Veranstaltungstag wird der gesamte Teilnahmebetrag fällig
- gern akzeptieren wir ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer
- **Anmeldung bis 30.12.2023**

Für die Teilnahme am Online-Seminar erhalten Sie nach erfolgter Anmeldung weitere Informationen bzw. Zugangsdaten.

Anmeldung

Bitte melden Sie sich sowohl für die Präsenzveranstaltung als auch für das Online-Seminar mit dem beigefügten Formular verbindlich an: per Fax 0331 2883 0059 oder per E-Mail mit dem Betreff „Vorstands-Akademie“ an: dorothea.hill@rolandeller.de

„Zwei wertvolle Tage mit tiefen Einblicken in die Aufsichtspraxis, kurzweiligen Vorträgen und einem hilfreichen Austausch.“

Alexander Thau
Vorstand, Sparkasse Wolfach

INFOS

SCP | REAL INVESTMENT Deutschland

DER 360-Grad Spezialist und Vordenker für Treasury/Depot-A von Banken & Sparkassen sowie speziell bei Immobilienfonds.

Investments für Banken und Sparkassen im Treasury/Depot-A haben seit jeher besondere Anforderungen bei Implementierung und Reporting. Darüber hinaus werden diese nach wie vor fast immer noch branchenweit wie Investments für andere institutionelle Anleger (Pensionskassen, Versorgungswerke, Versicherungen, Stiftungen,...) gemanagt, allokiert und optimiert. Doch spätestens seit Gültigkeit der CRR II seit Juni 2021 und mit der ab 2025 geplanten CRR III, der neuen RTF seit 2023 sowie der 7. Ma-Risk-Novelle kann das ein erheblicher Nachteil für die Banken & Sparkassen sein. Denn neben dem Ertrag auf das eingesetzte wirtschaftliche Investmentkapital kommen für Banken & Sparkassen im Treasury/Depot-A noch weitere Aspekte und Nebenbedingungen hinzu (normative und ökonomische Perspektive, Reporting, Meldewesen, Refinanzierungskosten, Risikomessung und -darstellung, Limitsystem, ESG, Liquidität, Steuern...). Für die SCP-R sind daher Banken & Sparkassen im Treasury/Depot-A nicht nur EINE unter den verschiedenen institutionellen Investorengruppen, Sie sind DIE KERNINVESTORENGRUPPE, an der sich alles ausrichtet:

Mit dem LLB Semper Real Deutschland wurde der erste (und einzige?) Immobilienfonds speziell für das Treasury/Depot-A von Banken & Sparkassen entwickelt. Die hierbei für den internen Bedarf der SCP-R entwickelten Analyse-, Vergleichs,- und Darstellungsprogramme stießen bei Banken & Sparkassen auf so hohes Interesse, dass daraus die umfassenden Programme **iTREASURY**, **iPUNKT** und **iKREDIT** entwickelt wurden.

ANMELDUNG

Anmeldung für
Präsenzveranstaltung oder Online-Seminar

Jetzt
anmelden



Ihre Ansprechpartnerin für weitere Informationen:

Dorothea Hill

dorothea.hill@rolandeller.de

Telefon: 0331 2883 0052

www.rolandeller.de



ROLAND ELLER

| Consulting | Training |

Roland Eller Consulting GmbH

Postanschrift: Alleestraße 13 | 14469 Potsdam

Tel: 0331 2883 0050 | info@rolandeller.de