

ID 3681 9. Bundesweiter Erfahrungsaustausch Kapitalallokation und Risikotragfähigkeit

Zielgruppe

Die Veranstaltung richtet sich insbesondere an die Fach- und Führungsebenen der betriebswirtschaftlichen Abteilungen (Controlling, Treasury, Handel, Revision) der Institute der Sparkassen-Finanzgruppe, die bereits Erfahrungen bei der Einführung oder in der praktischen Umsetzung der Kapitalallokation und der Risikotragfähigkeit haben.

Auch bei Interesse an der Einführung der Methoden des DSGVO zur Kapitalallokation und zur Risikotragfähigkeit, sowie bei der Anwendung des Programms S-KARISMA/S-RTF bietet dieser Erfahrungsaustausch viele Anregungen und Tipps für die Praxis.

Ziele

Neben Vorträgen im Plenum erhalten Sie die Gelegenheit sich in den Workshops aktiv über die Themen Kapitalallokation und Risikotragfähigkeit auszutauschen. Darüber hinaus können Sie sich über die aktuellen Unterstützungsleistungen und den neuesten Stand der Software S-KARISMA/S-RTF informieren. Die Veranstaltung bietet den Raum zum persönlichen und überregionalen Austausch mit Sparkassen und Vertretern der Verbände.

Durch die Integration einer Reihe von Sparkassenvorträgen steht der Praxisbezug im Vordergrund.

Ferner werden erneut umfangreiche Informationen von den Kapitalanlagegesellschaften und den Dienstleistern der S-Finanzgruppe angeboten.

Termin	ID	Ort	Anmeldeschluss	TN
15./16.05.2018	3681 801	Landshut	23.04.2018	250
Ansprechpartner	Inhaltlich	Peter Koch	Tel. 089 2173-1694	
	Organisatorisch	Regina Götting-Johannes	Tel. 0871 504-2273	
Dozenten	Diese entnehmen Sie bitte den jeweiligen Vorträgen/Workshops			
Preis	620,00 €			

Veranstaltungsablauf

1. Tag, 15.05.2018		2. Tag: 16.05.2018	
Beginn:	10:00 Uhr	Beginn:	09:00 Uhr
Ende:	ca. 18:00 Uhr	Ende:	ca. 16:00 Uhr
Anschließend:	Abendveranstaltung		

Hinweise

- An beiden Veranstaltungstagen finden wechselweise Workshops und Vorträge statt.
- Den detaillierten Programmablauf für diese Veranstaltung veröffentlichen wir zeitnah vor der Veranstaltung über BIKOS-Portal.
- **Anmeldeverfahren für außerbayerische Sparkassen und Verbundpartner**
Wir bitten die Personalentwicklung, sich bei Regina Götting-Johannes telefonisch in Verbindung zu setzen. Bitte beachten Sie hierzu auch die Informationen auf der letzten Seite.
Hinweis: Frau Götting-Johannes in der KW 14 wegen Urlaub nicht erreichbar.

I. Plenumsveranstaltungen in der Aula:

Begrüßung, Vorstellung der Dozenten und des Veranstaltungsablaufs

- *Impulsvortrag* -

Nach "Performance" bitte - Hin- und Zurück!

- Steuerung im "SREP-Zeitalter"
- Wird Betriebswirtschaft neu definiert?

Dozent: Günther Keller, Direktor Sparkassenverband Bayern

Risiko- und Ertragssteuerung in Sparkassen heute und morgen

- Aktuelle Themen des Fachrates Banksteuerung
- Ausrichtung der Vermögensanlage im Niedrigzinsumfeld am Beispiel der Sparkasse Saarbrücken
- Implikationen zur Umsetzung von Sparkassen

Dozent: Frank Saar, Vorstandsmitglied Sparkasse Saarbrücken

Der neue aufsichtliche Leitfaden zur Risikotragfähigkeit

Dozentin: Angela Hofmann, Deutsche Bundesbank

Investments 2030 – Chancen in einer veränderten Welt

- Blockchain – die neue Chance für Entwicklungsländer abseits von Bitcoin
- Künstliche Intelligenz – ein Hype um nichts?
- Soziale Gerechtigkeit – wie heutige Gewinner zu Verlierern werden
- Klassische Investments – nichts bleibt, wie es ist

Dozent: Josef Gruber, Bereichsleiter BayernLB

Europäische Trends in Hinblick auf die Banksteuerung von Sparkassen

- Standardisierung im Aufsichtsrecht
- Zusammenspiel Handelsrecht und Aufsichtsrecht
- Non-Performing-Loans

Dozent: Dr. Maik Grabau, Direktor Deutscher Sparkassen- und Giroverband



II. Workshops/Praxisworkshops/PC-Workshops

Die Workshops dauern jeweils 1 Stunde und finden je nach Bedarf statt.

Sie haben die Möglichkeit aus den folgenden **14 angebotenen Themen** an **6 Workshops** teilzunehmen.

Bitte beachten Sie:

- Der **Workshop Nr. 11** ist ein **PC-Workshop**.
- Bitte geben Sie mit der **Anmeldung** Ihre **6 Favoriten** an.
- Ihren persönlichen Zeitplan erhalten Sie an der Tagung.

WS 01	Prospektive Asset Allocation der Sparkasse Nürnberg <ul style="list-style-type: none">▪ Ausgangssituation und Vorgehensweise bei der Asset Allocation▪ Aspekte bei der Assetklassenwahl und Diskussion über alternative Anlageformen▪ Umsetzung und Mandatsstrukturierung unter Berücksichtigung der aktuellen aufsichtlichen Anforderungen <p>Dozentin: Claudia Meier, Sparkasse Nürnberg</p>
WS 02	Asset Allocation - Einführung, Standardisierung und Stabilisierung <ul style="list-style-type: none">▪ Der Weg von dem Erfordernis zum Nutzen▪ Die „neue Technik“ in der Gesamtbanksteuerung▪ Auf dem Weg zur Standardisierung▪ Die willkürfreie Allocation des Vermögens? <p>Dozent: Alexander Diroll, Sparkasse Rhein-Nahe</p>
WS 03	Asset Allocation im Spannungsfeld erhöhter Kapitalanforderungen <ul style="list-style-type: none">▪ Überblick: Kapitalanforderungen für Eigenanlagen▪ Simulation: MPR unter Berücksichtigung der SR Standardparameter sowie transparenter Fondsanlagen▪ Kennzahlen: modifizierter RORAC als Entscheidungshilfe▪ Ergebnisse: Bewertung und Handlungsimpulse <p>Dozenten: Jens-Peter Kempf, DekaBank Lars Mohlau, DekaBank</p>
WS 04	Welchen Nutzen und Ertrag hat uns die Kapitalallokation gebracht? Was bringt sie uns morgen? <ul style="list-style-type: none">▪ Performanceanalyse im Rückblick – eine Auswertung über verschiedene Sparkassen▪ Mehrertrag aus der Optimierungsrechnung im „Rückspiegel“ (ex post-Analyse)▪ Optimierungsimpulse im aktuellen Niedrigzinsumfeld <p>Dozenten: Dr. Andreas Beck, ICnova Frank Blass, ICnova</p>
WS 05	Infrastruktur als alternative Anlageklasse <ul style="list-style-type: none">▪ Der Infrastrukturmarkt (Investitionsbedarf Öffentliche Hand versus private Investitionen)▪ Abgrenzung / Definition der Assetklasse Infrastruktur▪ Umsetzungsformen für Infrastrukturinvestitionen <p>Dozentin: Dr. Susanne Effenberger, HelabelInvest</p>

WS 06

Fehlsteuerung im Zinsänderungsrisiko durch Ausrichtung an aufsichtsrechtlichen Vorgaben

- Aktuelle aufsichtsrechtliche Restriktionen für Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch
- Darstellung der Auswirkungen auf das Zinsänderungsrisiko durch Anwendung aufsichtlicher Restriktionen im ökonomischen Steuerungsprozess
- Konsequenzen der aufsichtlichen Vorgaben für die Finanzgruppen der LSIs

Dozenten: Dr. Kerstin Drachter, Bundesverband der Volks- und Raiffeisenbanken
Olaf Wegner, Deutscher Sparkassen- und Giroverband

WS 07

Management von Reputationsrisiken - Nachhaltigkeitslösungen für Sparkassen

- Gesetzliche Verpflichtung zur Erstellung eines Nachhaltigkeitsberichtes
- Das Nachhaltigkeitsresearch der LBBW als Unterstützung für Sparkassen
- Die LBBW Asset Management als Partner der Sparkassen für nachhaltige Investmentlösungen
- Der "Green Bond" der LBBW als interessante nachhaltige Anlagealternative

Dozenten: Michael Flämig, Landesbank Baden-Württemberg
Daniel Hemminger, Landesbank Baden-Württemberg Asset Management
Armin Weber, Landesbank Baden-Württemberg

WS 08

ILAAP: Möglichkeiten ökonomische Ziele und aufsichtliche Anforderungen sinnvoll zu verbinden

- Was ist der ILAAP?
- Welche aufsichtlichen Anforderungen bestehen?
- Welche ökonomischen Ziele können verfolgt werden?
- Ertrag vs. Nutzung von Assets im Liquiditätsdeckungspotenzial

Dozenten: Jens Meyer, HASPA
Leon Unger, Deutscher Sparkassen- und Giroverband

WS 09

Entwicklungen im Kapitalmanagement

- Neue RTF-Regularien – Was erwartet die Aufsicht?
- Erkenntnisse aus Proberechnungen zur neuen RTF
- Steuerung unter RTF, SREP und strategischer Planung
- Erkenntnisse aus dem SREP 2016/2017 sowie Eigenmittelzielkennziffer

Dozent: Jörg Friedberg, Deutscher Sparkassen- und Giroverband

WS 10

Praxisbeispiel Liquidationsansatz - Erfahrungen für die zukünftige Ökonomische Perspektive

- Vorstellung Praxisbeispiel eines etablierten Liquidationsansatzes in einer Sparkasse
- Ideen zur konkreten Umsetzung der neuen Vorgaben des überarbeiteten RTF-Leitfadens
- Zusammenspiel der neuen normativen und ökonomischen Perspektiven in der Steuerung

Dozent: Dr. Daniel Baumgarten, Sparkasse KölnBonn



WS 11	Grundlagen von S-RTF inkl. Neuerungen
PC-WS	<ul style="list-style-type: none">▪ Einführung und Parametrisierung▪ Kapitalplanung und Periodische RTF▪ Reporting und RTF-Meldewesen
	Dozent: Tobias Leiber, Sparkassenverband Bayern
WS 12	Gesamtbankstresstests - Standardparameter für den Stressfall
	<ul style="list-style-type: none">▪ Aktueller Projektstand▪ Geplante Ergebnistypen▪ Methodik: Standardszenarien und aktueller Stand der Standardparameter▪ Ausblick
	Dozenten: Frau Maria Frick, S Rating und Risikosysteme GmbH Mario Düran, S Rating und Risikosysteme GmbH
WS 13	Risikohandbuch - Rahmenwerk mit den Standard-Methoden und -Verfahren des Risikomanagements für die Sparkassen
	<ul style="list-style-type: none">▪ Aktueller Projektstand▪ Aufbau des Risikohandbuches und Verwendung für die SFO der Sparkasse▪ Überblick über Inhalte▪ Ausblick
	Dozenten: Matthias Helle, S Rating und Risikosysteme GmbH Paul Pradel, S Rating und Risikosysteme GmbH
WS 14	Neue Risikotragfähigkeit - Ausblick auf die operative Umsetzung
	<ul style="list-style-type: none">▪ Aufgaben der SR / Überblick über die Mittelfristplanung▪ Eckpunkte der neuen Risikotragfähigkeit▪ Aktueller Projektstand▪ Ausblick / Geplanter Entwicklungspfad
	Dozenten: Frau Kerstin Alpen, S Rating und Risikosysteme GmbH Alexander Paschek, S Rating und Risikosysteme GmbH

III. Info-Stände:

Im Foyer bieten folgende Partner der S-Finanzgruppe Informationsgespräche an:

- S Rating und Risikosysteme GmbH
- BayernInvest
- DEKA
- REAL I.S. AG
- NordLB Asset Management
- HelabaInvest
- LBBW Asset Management
- ICnova AG
- S-Servicepartner Deutschland GmbH
- Finanzinformatik

IV. Abendveranstaltung:

Ab ca. 18:15 Uhr „Von Träumen, Disziplin und dem richtigen Quäntchen Glück!“ (Nicola Baumann)

Ab ca. 19:15 Uhr Maifest mit gemeinsamen Abendessen



Anlage

Informationen zur Anmeldungen für außerbayerische Sparkassen und Verbundpartner

- **Anmeldeverfahren für außerbayerische Sparkassen und Verbundpartner**

Wir bitten die Personalentwicklung, sich kurz bei Regina Götting-Johannes telefonisch zu melden, falls Sie noch keine Zugangsdaten (Web-Bucher) zum BIKOS-Portal haben. Bitte beachten Sie, dass Frau Götting-Johannes in der KW 14 wegen Urlaub nicht erreichbar ist.

- **Gebühren**

Veranstaltungsgebühr	620,00 €
je Übernachtung	60,00 €*
je Frühstück	9,00 €*
je Mittagessen	18,00 €*
Abendessen (Vorabend, falls gebucht)	10,00 €*
Abendessen (Veranstaltung)	30,00 €*

*Gebühren verstehen sich zuzüglich Umsatzsteuer.

- **Flughafentransfer oder Transfer zum Bahnhof Landshut**

- **Hinfahrt zur Sparkassenakademie Bayern**

Bitte nehmen Sie sich am Flughafen ein Taxi, alternativ gibt es einen Flughafenbus nach Landshut. Die Fahrzeit beträgt ca. 35 Minuten. Fahrzeiten entnehmen Sie gern auf unserer Homepage:

<https://www.sparkassenakademie-bayern.de/kontakt-und-anreise/anreise/>

Sie kommen mit dem Flughafenbus in Landshut/Altstadt an, von dort aus geht die Reise mit dem Stadtbus weiter (ca. 10 Minuten). Auch diesen Busfahrplan finden Sie im oben genannten Link bei „**Hilfreiche Informationen für Bahnreisende**“.

- **Rückfahrt zum Flughafen/Bahnhof Landshut**

Wir haben für Sie Busse für den Rücktransport organisiert und bitten Sie bei Ihrer Anmeldung zur Veranstaltung uns mitzuteilen, ob Sie einen Rücktransport benötigen.

Wir bieten Ihnen folgende Auswahlmöglichkeiten an:

- **Busfahrt zum Bahnhof**
(Abfahrt 15 Minuten nach Veranstaltungsende/Fahrzeit ca. 20 Minuten)
- **Busfahrt zum Flughafen**
(Abfahrt 15 Minuten nach Veranstaltungsende/Fahrzeit ca. 45 Minuten)

