

EINLADUNG ZU DEN WORKSHOPS

Mathematisch- statistische Methoden der Kreditrisikomodellierung

15. Mai 2023

IN FRANKFURT AM MAIN

Entwicklung von PD- und LGD-/EAD-Modellen

16. und 17. Mai 2023

IN FRANKFURT AM MAIN

Kreditportfoliomodelle

27. und 28. Juni 2023

IN FRANKFURT AM MAIN

Validierung interner Ratingsysteme

27. und 28. September 2023

IN FRANKFURT AM MAIN

Aufsichtsrechtliche Anforderungen an Rating- modelle (PD und LGD)

ONLINE

14. und 15. November 2023

Modellierung des Lifetime Expected Loss im Rahmen von IFRS 9 bzw. IDW RS BFA 7

NEU

21. November 2023

IN FRANKFURT AM MAIN

Ausgestaltung der RTF in ökonomischer und normativer Perspektive

NEU

22. November 2023

IN FRANKFURT AM MAIN



Weitere Informationen im Innenteil oder unter www.risk-research.de

Risk Research berät seit zwei Jahrzehnten erfolgreich internationale Großbanken, mittelständische Kreditinstitute, Unternehmen aus der Leasing- und Factoringbranche sowie FinTechs im Bereich Risikomanagement. Unsere Kernkompetenzen liegen hierbei im Kreditrisikomanagement und der Ausgestaltung von Risikotragfähigkeitskonzepten.

Zudem unterstützen wir unsere Kunden im Bereich Data Science – bei der Entwicklung datengetriebener Entscheidungssysteme, dem Einsatz maschineller Lernverfahren und Algorithmen sowie der zunehmenden Automatisierung von Prozessen und Auswertungen.

Darüber hinaus veranstalten wir regelmäßig fachspezifische Workshops und individuelle Inhouse-Trainings mit namhaften Dozentinnen und Dozenten aus Forschung und Praxis. Hierbei stehen aktuelle fachliche und aufsichtsrechtliche Entwicklungen im Risikomanagement sowie allgemeine Grundlagen des Risikomanagements im Fokus.

Unser Veranstaltungsprogramm wird kontinuierlich unter Berücksichtigung aktueller Trends und Ergebnisse in der Forschung weiterentwickelt.

Unsere Workshops bieten Ihnen folgende Vorteile:

- Expertinnen und Experten aus Forschung und Praxis vermitteln sorgfältig aufeinander abgestimmte Inhalte
- Direkter Erfahrungsaustausch zwischen Referierenden und Teilnehmenden aus Kreditinstituten, Bankaufsicht und Verbänden
- Hoher Praxisbezug durch Fachvorträge, Praxisberichte und Fallstudien

Neben den Präsenz-Workshops bieten wir Ihnen einen Online-Workshop an. Auch hierbei gewährleisten wir Ihnen größtmögliche Interaktivität. Sie können auch bei unserem Online-Workshop jederzeit Fragen an die Referierenden oder die anderen Teilnehmenden stellen.

Inhouse-Trainings

Sie bevorzugen einen **exklusiven Workshop** für Ihr Team, der individuell auf Ihre Bedürfnisse zugeschnitten ist? Neben unseren Workshops bieten wir Inhouse-Trainings zu allen Aspekten unserer Beratungstätigkeit an. Auch sämtliche von uns angebotenen Workshops sind im Rahmen von Inhouse-Trainings buchbar. Zugeschnitten auf die **speziellen Bedürfnisse Ihres Unternehmens** erarbeiten wir gemeinsam mit Ihnen das Trainingsprogramm hinsichtlich Dauer, Inhalt und Methoden. Viele unserer Kunden nutzen diese Schulungen als effiziente Methode, um sich aktuellen Themen anzunähern und ein gemeinsames Verständnis zu entwickeln.

Rufen Sie uns an oder schreiben Sie uns. Wir beraten Sie gerne! Tel.: +49 (0)941/89 96 64-20 oder E-Mail: info@risk-research.de

NEU IM PROGRAMM

Modellierung des Lifetime Expected Loss im Rahmen von IFRS 9 bzw. IDW RS BFA 7

21. November 2023 in Frankfurt am Main

Themenschwerpunkte:

- Grundlagen der Wertminderungsvorschriften nach IFRS 9 bzw. der Pauschalwertberichtigungen nach IDW RS BFA 7
- Migrationsmatrizen und Mehrjahres-PDs
- Modellierung von Point-in-Time-Parametern (PD, LGD und CCF) und makroökonomische Prognosemodelle
- Geplant ist außerdem ein Vortrag zu Verknüpfungen mit Stresstesting/Kapitalplanung

Ausgestaltung der RTF in ökonomischer und normativer Perspektive

22. November 2023 in Frankfurt am Main

Themenschwerpunkte:

- Einführung in die Thematik
 - Historische Entwicklung der Risikotragfähigkeitsrechnung
 - Struktur der RTF-Rechnung ab dem 01.01.2023
 - Einordnung der RTF-Rechnung im regulatorischen Kontext
- Deep Dive ökonomische Perspektive – Aufbau der Risikodeckungsmasse
 - Deep Dive normative Perspektive – Kapitalplanung
 - Einbindung der RTF-Perspektiven in den ICAAP
 - Einbindung von ESG-Risiken in den ICAAP
 - Aufsichtlicher Blick

Ausführlichere Informationen zu unseren neuen Workshops finden Sie in Kürze unter www.risk-research.de/workshops

NEWSLETTER



In unserem Newsletter informieren wir Sie regelmäßig über Neuigkeiten zu unseren Fokusthemen und Veranstaltungen sowie Entwicklungen rund um unser Unternehmen. Wenn Sie diesen kostenlos abonnieren möchten, tragen Sie bitte einfach Ihre E-Mail-Adresse auf der Startseite unserer Homepage unter „Newsletter“ ein.

So bleiben Sie immer über aktuelle Trends aus Forschung und Bankpraxis informiert.

Mathematisch-statistische Methoden der Kreditrisikomodellierung

Vorteilspreis
in Kombination mit
anderen Workshops

15. Mai 2023

09:00	Begrüßung und Einführung in die Thematik <i>Referent: Prof. Dr. Christian Scherr, Risk Research</i>	15:15	Generalisierte lineare Modelle <i>Referent: Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg</i> – Definition, Modelle und Anwendungsbereiche – Schätzung, Inferenz und Interpretation – Softwaregestützte Fallstudie: PD- und LGD-Prognose
09:15	Mathematisch-statistische Methoden (Teil 1) <i>Referent: Prof. Dr. Christian Scherr, Risk Research</i> – Wichtige mathematische Funktionen und Methoden – Wahrscheinlichkeitsbasierte Modellierung von Kreditrisiken	16:15	Kaffeepause
10:45	Kaffeepause	16:30	Zeitreihenmodellierung und -analyse <i>Referent: Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg</i> – Abgrenzung Querschnitts-, Zeitreihen- und Paneldaten – Stilisierte Fakten von Zeitreihen – Klassische Zeitreihenanalyse – Autokorrelation, Stationarität/Stabilität – AR-, ARMA-, ARIMA-, GARCH-Modelle – Schätzung, Inferenz und Interpretation – Softwaregestützte Anwendungen im Risikomanagement mittels realer Daten
11:15	Mathematisch-statistische Methoden (Teil 2) <i>Referent: Prof. Dr. Christian Scherr, Risk Research</i> – Grundlegende Techniken zur Schätzung von Risikoparametern – Konzeption und Durchführung von statistischen Testverfahren	17:30	Ende des Workshops
12:45	Gemeinsames Mittagessen		
14:00	Schätzen und Testen im linearen Regressionsmodell <i>Referent: Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg</i> – Modell der linearen Regression – Ermittlung von Parameterschätzwerten – Testen von Hypothesen – Erstellen von Prognosen – Diagnostische Tools – Softwaregestützte Fallstudie: LGD-Prognose		
15:00	Kaffeepause		

Dieser Workshop ist konzipiert für Fach- und Führungskräfte in Banken, welche ihre Kenntnisse in angewandter Statistik erneuern oder vertiefen möchten. Zudem richtet sich der Workshop auch an alle Institutsmitarbeitenden, deren Tätigkeitsfeld Schnittstellen zum quantitativen Risikomanagement aufweist und die beabsichtigen, ihr Wissen bzgl. der hierbei eingesetzten statistischen Methoden zu festigen oder zu erweitern.

Aufsichtsrechtliche Anforderungen an Ratingmodelle (PD und LGD)

ONLINE

14. November 2023

12:45	Login
13:00	Begrüßung und Einführung in die Thematik <i>Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research</i> – Struktur und Aufgaben der Bankenaufsicht in Deutschland – Hintergrund: Von Basel I zu Basel III – Überblick über aufsichtsrechtliche Anforderungen an Ratingmodelle
14:15	Pause
14:30	Anforderungen der MaRisk und der CRR <i>Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research</i> – Anforderungen der MaRisk – Anforderungen der CRR – Anforderungen ausgewählter Delegierter Verordnungen/RTS
15:15	Pause
15:30	Der bankaufsichtliche Blick <i>Referent: in: Deutsche Bundesbank angefragt</i> – Erfahrungen aus der Prüfungspraxis – Proportionalitätsprinzip – Margin of Conservatism (MoC) – Aktuelle internationale Entwicklungen
17:00	Ende des ersten Workshoptages

15. November 2023

12:45	Login
13:00	Anforderungen der EBA-Leitlinien für die PD-Schätzung, die LGD-Schätzung und die Behandlung von ausgefallenen Risikopositionen (EBA/GL/2017/16) (Teil 1) <i>Referent: Daniel Rudek, Risk Research</i> – Aufbau und Überblick – Allgemeine Anforderungen – PD-Schätzung – Modellentwicklung – Modellkalibrierung
15:00	Pause
15:30	Anforderungen der EBA-Leitlinien für die PD-Schätzung, die LGD-Schätzung und die Behandlung von ausgefallenen Risikopositionen (EBA/GL/2017/16) (Teil 2) <i>Referent: Daniel Rudek, Risk Research</i> – LGD-Schätzung – Parameterschätzung für ausgefallene Forderungen (EL _{BE} and LGD in-default) – Anwendung der Modelle
17:00	Ende des Workshops

Entwicklung von PD- und LGD-/EAD-Modellen

Sichern Sie sich Ihren
Frühbuchervorteil bis zum
15. April 2023!

16. Mai 2023

- 09:00 **Begrüßung und Einführung in die Thematik: Grundlagen der Modellierung**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Überblick
 - Aufsichtsrechtliche Sicht
 - Point-in-Time vs. Through-the-Cycle und weitere Besonderheiten der Modellierung
- 10:30 Kaffeepause
- 11:00 **Modelle und Methoden zur Messung von PD und LGD (Teil 1)**
Referent: Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg
- PD- und LGD-Modellierung
 - bedingte vs. unbedingte Parameter
 - risikoneutrale vs. reale Sichtweise
 - Ratings und Masterskalen
 - Point-in-Time vs. Through-the-Cycle
 - Statistisch-ökonomische Schätzverfahren
 - Marktdaten- vs. Ausfalldaten-basierte Schätzung
 - zeitstetige und zeitdiskrete Hazardraten- und Regressionsmodelle
 - Schätz-, Prognose- und Modellrisiken
 - Praxisbeispiele und potenzielle Fallstricke
- 12:45 Gemeinsames Mittagessen
- 14:00 **Modelle und Methoden zur Messung von PD und LGD (Teil 2)**
Referent: Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg
- Fortgeschrittene Methoden
 - Frailty- und Random-Effects-Modelle
 - Low-Default-Portfolios
 - Bayesianische Verfahren
 - Modelle für zensierte Daten
- 15:45 Kaffeepause
- 16:15 **Entwicklung von PD-Modellen**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- Prozess der PD-Modellierung
 - Anforderungen an die Datenbasis
 - Auswahl und Aggregation von Modellbestandteilen
 - Ausgewählte Fallstudien
- 18:00 **Get together**
Wir laden Sie herzlich zu einem gemeinsamen Umtrunk und kleinen Speisen ein.

17. Mai 2023

- 09:00 **Migrationsmatrizen und Mehrjahres-PDs**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- 10:00 Kaffeepause
- 10:30 **Konjunkturabhängige Modellierung von Szenario- und Stresstestparametern in der Bankpraxis**
Referent: Dr. Korbinian Christ, Landesbank Hessen-Thüringen
- Herausforderungen der Modellentwicklung
 - Prozessuale Stolpersteine
 - Grenzen der Anwendbarkeit
 - Schnittstellen zu Planung, Steuerung und ökonomischer Risikomessung
- 12:00 Gemeinsames Mittagessen
- 13:15 **Entwicklung von LGD-/EAD-Modellen**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- Überblick und Definitionen
 - Aufbau und Parametrisierung
 - Downturn-Modellierung
 - LGD in-default und EL_{BE}
 - Herausforderungen der praktischen Umsetzung
- 15:45 Kaffeepause
- 16:15 **Modellrisiko und Herausforderungen der Modellierung in der Bankpraxis – mit Diskussion**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- 17:30 Ende des Workshops

Stimmen zum Workshop

„Optimale Balance der behandelten Themen zwischen theoretischen Grundlagen und praktischer Umsetzung.“
(B. Kückkeris, abcfinance)

„Praxisnah & gut vermittelt!“
(T. Stützer, DZ Bank)

„Eine gute Mischung aus einer akademischen und praxisbezogenen Sichtweise. Tiefer Einblick in die Modellwelt.“
(M. Dürk; DZ PRIVATBANK)

„Alternativlos.“
(M. Bauch, GBB-Rating)

27. Juni 2023

- 09:30 **Einführung und Überblick**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Überblick über die Veranstaltung
 - Nutzen und Einsatz von Kreditportfoliomodellen
 - Risiko des Kreditportfolios – Default-Mode vs. Mark-to-Market
 - Point-in-Time- vs. Through-the-Cycle-Modellierung
- 10:00 **Allgemeiner Aufbau von Kreditportfoliomodellen – Default-Mode**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Allgemeiner Aufbau
 - Verlustverteilung und Risikomaße
 - Sensitivitätsanalysen
 - Modellierung der Inputbausteine
 - Kurzüberblick zu PD, LGD und EAD
 - Modellierung von Abhängigkeitsstrukturen/Korrelationen: Überblick über Ansätze und Herausforderungen
 - Wesentliche Industriemodelle, u.a. CreditMetrics im Default Mode, CreditRisk⁺
 - Modellerweiterungen
- 11:45 Kaffeepause
- 12:00 **Allgemeiner Aufbau von Kreditportfoliomodellen – Mark-to-Market (Teil 1)**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Allgemeiner Aufbau
 - Verlustverteilung und Risikomaße
 - Sensitivitätsanalysen
- 13:00 Gemeinsames Mittagessen
- 14:15 **Allgemeiner Aufbau von Kreditportfoliomodellen – Mark-to-Market (Teil 2)**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Modellierung der Inputbausteine
 - Kurzüberblick zu Zinsstrukturkurven, zustandsabhängige Barwerte
 - Migrationsmatrix: Modellierung und Herausforderungen
 - Wesentliche Industriemodelle, u.a. CreditMetrics
 - Modellerweiterungen
- 15:00 **Modellierung und Messung von PD und Korrelationen (Teil 1)**
Referent: Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg
- Grundlagen zur Modellierung von Ausfallkorrelationen
 - Modellierung von Kreditnehmerabhängigkeiten
 - Faktor- und Copulamodelle
 - Modellvergleiche
- 16:30 Kaffeepause
- 16:45 **Modellierung und Messung von PD und Korrelationen (Teil 2)**
Referent: Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg
- Statistisch-ökonomische Verfahren zur empirischen Messung von Korrelationen
 - Statische und dynamische Verfahren
 - Prognose von korrelierten Kreditausfällen und Portfolioverlusten
 - Modell- und Parameterrisiken, Ansätze für Stresstests
- 18:00 **Get together**
Wir laden Sie herzlich zu einem gemeinsamen Umtrunk und kleinen Speisen ein.

28. Juni 2023

- 09:00 **Aufsichtsrechtliche Behandlung des Kreditrisikos: Kreditportfoliomodelle im Kontext der MaRisk**
Referentin: Xiao Müller-Yin, Deutsche Bundesbank
- Kreditportfoliomodelle im Rahmen der MaRisk
 - Problembereiche bei der Kreditportfoliomodellierung
 - Zukunft der Kreditportfoliomodelle in Säule II
- 10:00 **Diskussion mit Frau Xiao Müller-Yin: Kreditportfoliomodelle im Kontext der MaRisk**
Moderation: Dr. Michael Knapp
- Wir laden Sie ein, gemeinsam mit Frau Xiao Müller-Yin über aktuelle Fragestellungen zu Kreditportfoliomodellen im Kontext der MaRisk zu diskutieren.
- 10:30 Kaffeepause
- 11:00 **Kreditportfoliomodelle – Herausforderungen der Parametrisierung**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Konsistenz der Risikomessung
 - Point-in-Time vs. Through-the-Cycle bei Default-Mode- und Mark-to-Market-Modellen
 - Konstanz des Modellzusammenhangs
 - Modellierung von Korrelationen: Herausforderungen der Modellierung in der Praxis
 - Modellierung der Abhängigkeit zwischen Risikoparametern
 - Berücksichtigung des Schätz- und Prognoserisikos
 - Überblick über Prüfungsschwerpunkte
 - Institutsspezifische Konzeption eines Kreditportfoliomodells
- 12:30 Gemeinsames Mittagessen
- 13:45 **Praxisbeispiel eines Kreditportfoliomodells und Messung von Risikokonzentrationen**
Referent: Thomas Werndl CRM, Risk Research
- 14:45 Kaffeepause
- 15:00 **Validierung von Kreditportfoliomodellen und Korrelationen**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- 15:45 **Modellrisiko**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- 16:15 **Diskussion: Einsatz von Kreditportfoliomodellen in der Praxis – Erfahrungsaustausch**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- 17:00 Ende des Workshops

Stimmen zum Workshop

„Tolles Komplettpaket zwischen Theorie, Praxis und Austausch untereinander!“
(A. Konieczny, abcfinance)

„Hohe Kompetenz/Adressatengerechte Ansprache.“
(C. Kramer, Berliner Sparkasse)

Validierung interner Ratingsysteme

Frühbuchervorteil
bis 1. August 2023:
200 EUR für beide Tage

27. September 2023 (Einzeltag buchbar)

PD-Validierung

- 09:00 **Begrüßung und Einführung in die Thematik: Grundlagen der PD-Validierung**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Grundlegende Begriffe
 - Überblick qualitative und quantitative Validierung
 - Aufsichtsrechtliche Aspekte
- 10:45 Kaffeepause
- 11:15 **Validierung von Ratingsystemen – Der bankaufsichtliche Blick**
Referent:in: Deutsche Bundesbank angefragt
- Bankaufsichtliche Aspekte
 - Erkenntnisse aus der IRB-Anwendung
 - Häufige Schwachstellen von Ratingsystemen
 - Prüfungsschwerpunkte
- 12:15 **Diskussion zu aufsichtsrechtlichen Aspekten**
Moderation: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Wir laden Sie ein, mit uns aktuelle Fragestellungen zu aufsichtsrechtlichen Aspekten zu diskutieren.
Referent:in der Deutschen Bundesbank ist angefragt.
- 12:45 Gemeinsames Mittagessen
- 14:00 **Validierung von PD-Prognosen mit Fallstudien: Trennschärfemaße**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Definition verschiedener Trennschärfemaße
 - Zufallscharakter der Trennschärfemaße
 - Herausforderungen und Fallstricke
 - Einsatz in der Praxis
- 15:30 Kaffeepause
- 16:00 **Validierung von PD-Prognosen mit Fallstudien: Kalibrierung und Modellstabilität**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- Statistische Testverfahren zur Überprüfung der Kalibrierung
 - Validierung von Low-Default-Portfolios
 - Erweiterungen und Anmerkungen
 - Überprüfung der Modellstabilität
- 17:45 **Modellrisiko und Herausforderungen der PD-Validierung in der Bankpraxis und Diskussion ausgewählter Probleme**
Referent: Dr. Michael Knapp, Risk Research
- 18:30 **Get together**
Wir laden Sie herzlich zu einem gemeinsamen Umtrunk und kleinen Speisen ein.

28. September 2023 (Einzeltag buchbar)

LGD-/EAD-Validierung

- 09:00 **Begrüßung und Einführung in die Thematik**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- 09:15 **Methoden der LGD-/EAD-Modellierung**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- Überblick und Definitionen
 - Downturn-Modellierung
 - LGD in-default und EL_{BE}
 - Herausforderungen der praktischen Umsetzung
- 10:45 Kaffeepause
- 11:15 **Grundlagen der LGD-/EAD-Validierung**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- Grundlegende Begriffe
 - Überblick qualitative und quantitative Validierung
 - Aufsichtsrechtliche Aspekte
- 11:45 **Verfahren der LGD-/EAD-Validierung mit Fallstudien (Teil 1)**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- Prozess der LGD-/EAD-Validierung
 - Qualitative LGD-/EAD-Validierung
- 12:45 Gemeinsames Mittagessen
- 14:00 **Verfahren der LGD-/EAD-Validierung mit Fallstudien (Teil 2)**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- Quantitative LGD-/EAD-Validierung
 - Ausgewählte Herausforderungen
- 15:15 Kaffeepause
- 15:30 **Vorgehensweise und Herausforderungen in der Praxis**
Referent: Dr. Matthias Fischer, Bayerische Landesbank
- Prüfbereiche (quantitativ, qualitativ, prozessual)
 - Organisation
 - Datenerfassung
 - Strukturelle Informationslücken
- 17:00 Kaffeepause
- 17:15 **Herausforderungen der LGD-/EAD-Validierung in der Bankpraxis und Diskussion ausgewählter Probleme**
Referent: Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research
- 17:45 Ende des Workshops

Stimme zum Workshop

„Theorie und Praxis wurden verständlich in einem angemessenen Verhältnis vorgetragen.“
(I. Piecyk, Hamburg Commercial Bank)

Dr. Korbinian Christ, Landesbank Hessen-Thüringen

Dr. Korbinian Christ ist stellvertretender Leiter Adressenausfallrisiken in der Landesbank Hessen-Thüringen. Nach dem Studium der Betriebswirtschaftslehre promovierte er am Lehrstuhl für Statistik an der Universität Regensburg zum Thema „Quantitative Kreditportfoliooptimierung“. Parallel beriet er verschiedene Banken zum Thema Kreditrisikomodellierung und -optimierung. Seit 2008 ist Herr Dr. Christ in der Helaba tätig, wo er zunächst für die Modellierung von Ausfallwahrscheinlichkeiten zuständig war. Seit 2011 verantwortet er die Modellierung und Anwendung der konjunkturabhängigen Szenarioparameter inklusive der Parameterstresstests, seit 2014 auch die Entwicklung des Kreditportfoliomodells.

Dr. Matthias Fischer, BayernLB

Dr. Matthias Fischer ist aktuell in leitender Position im Risikocontrolling in der BayernLB, München tätig. Nach seinem Studium in Mathematik und anschließender Promotion in Statistik und Ökonometrie an der Universität Erlangen-Nürnberg war er in der Bank zunächst in der Weiterentwicklung des Kreditportfolios tätig. Danach betreute er u.a. für einige Jahre – in Zusammenarbeit mit der RSU – insbesondere die Entwicklung, Pflege und Validierung der LGD- und EAD-Modelle der BayernLB sowie die des Frühwarnsystems. Daneben verantwortete seine Gruppe die Weiterentwicklung des Kreditportfoliomodells sowie des OpVaR-Modells inklusive Stresstesting und konzipierte und berechnete den bilanziellen und ökonomischen Lifetime Expected Loss. In den genannten Themen ist er Verfasser zahlreicher Beiträge in verschiedenen nationalen und internationalen Fachzeitschriften. Seit Anfang 2020 leitet er die Methodenabteilung im Risikocontrolling.

Dr. Michael Knapp, Risk Research

Dr. Michael Knapp ist Geschäftsführer der Risk Research GmbH. Nach dem Studium der Betriebswirtschaftslehre promovierte Herr Dr. Knapp am Lehrstuhl für Statistik an der Universität Regensburg zum Thema „Zeitabhängige Kreditportfoliomodelle“. Seit über 20 Jahren ist Herr Dr. Knapp für eine Vielzahl von Finanzinstituten im Bereich Risikomanagement beratend tätig.

Xiao Müller-Yin, Deutsche Bundesbank

Xiao Müller-Yin studierte Mathematik an der Goethe Universität Frankfurt und ist seit 2015 in der Bankenaufsicht der Deutschen Bundesbank tätig. Sie arbeitet in der Grundsatzabteilung für bankgeschäftliche Prüfungen und betreut das Thema Adressrisikomesung in der Säule II mit Schwerpunkt Kreditportfoliomodellierung.

Prof. Dr. Daniel Rösch, Universität Regensburg

Prof. Dr. Daniel Rösch ist Inhaber des Lehrstuhls für Statistik und Risikomanagement an der Universität Regensburg. Zuvor war er Professor für Finanzierung und Direktor des Instituts für Banken und Finanzierung der Leibniz Universität Hannover. Seit 2006 bzw. 2011 ist er Gastprofessor an der University of Melbourne und der University of Technology in Sydney. Seine gegenwärtigen Forschungsschwerpunkte sind Risikomanagement, Credit Risk Analytics, Bankenaufsicht, Data Science und Machine Learning. Er ist Verfasser zahlreicher Beiträge in internationalen Fachzeitschriften sowie Referent auf internationalen Konferenzen und kooperiert mit Finanzinstituten und Finanzaufsichtsbehörden. Seine Arbeiten wurden mit mehreren Preisen und Forschungsförderungen ausgezeichnet.

Daniel Rudek, Risk Research

Daniel Rudek ist Senior Manager bei der Risk Research GmbH. Er studierte Wirtschaftsmathematik mit den Schwerpunkten Statistik, Optimierung und Financial Engineering und war von 2009 bis 2014 bei der msgGillardon AG als Senior Consultant tätig. Seit dieser Zeit berät er Finanz- und Kreditinstitute im Themengebiet Adressrisiko. Sein Beratungsfokus liegt dabei auf der Modellierung und Validierung der Risikoparameter PD, LGD und CCF.

Prof. Dr. Christian Scherr, Risk Research

Prof. Dr. Christian Scherr studierte Physik und Volkswirtschaftslehre an der Universität Regensburg und ist seit 2008 für die Risk Research GmbH tätig. Von 2010 bis 2012 promovierte er berufsbegeleitend über die zeitdynamische Bewertung von Kreditderivaten und wurde 2017 als Professor für Mathematik an die Technische Hochschule Nürnberg berufen. Die Beratungsschwerpunkte von Herrn Prof. Dr. Scherr liegen in der Modellierung von Ausfallwahrscheinlichkeiten sowie der Quantifizierung ökonomischer Risiken mit Hilfe zeitstetiger stochastischer Prozesse.

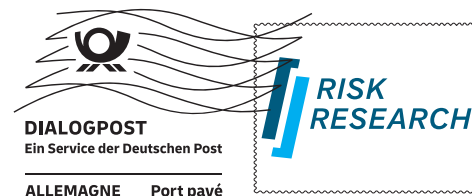
Thomas Werndl CRM, Risk Research

Thomas Werndl ist Director bei der Risk Research GmbH. Davor studierte er Betriebswirtschaftslehre mit den Schwerpunkten Finanzierung sowie Quantitative Finanzwirtschaft. Weiterhin absolvierte er 2013/14 nebenberuflich das Postgraduierten-Programm zum „Certified Risk Manager“ in der DVFA-Finanzakademie (Frankfurt am Main). Als Berater ist er seit mehreren Jahren v.a. in den Bereichen Modellierung und Validierung von PD und Korrelationen, Entwicklung von Kreditportfoliomodellen sowie der Umsetzung des IDW RS BFA 7 tätig.

Dr. Birker Winterfeldt, Risk Research

Dr. Birker Winterfeldt ist Director bei der Risk Research GmbH. Nach dem Studium der Betriebswirtschaftslehre promovierte er am Lehrstuhl für Statistik an der Universität Regensburg zum Thema „Konzentrationsrisiken in Kreditportfolios“. Seit 2004 berät Herr Dr. Winterfeldt internationale Großbanken und mittelständische Kreditinstitute im Bereich Kreditrisikomanagement. Seine Beratungsschwerpunkte liegen neben der Modellierung und Validierung der Risikoparameter PD, LGD und EAD (sowohl regulatorisch als auch im Kontext von IFRS 9 bzw. des IDW RS BFA 7) in der Umsetzung von Stresstests und der Parametrisierung von Kreditportfoliomodellen.

Workshopprogramm 2023



Risk Research GmbH, Furtmayrstraße 3, D-93053 Regensburg

ANMELDUNG

Telefon +49 (0)941/89 96 64-20
E-Mail workshop@risk-research.de
Internet risk-research.de/anmeldung

Tagungshotel für die Präsenz-Workshops

Adina Apartment Hotel Westend
Osloer Straße 3, D-60327 Frankfurt am Main
Tel.: +49 (0)69/247 420-556, E-Mail: frankfurt@adina.eu

Im Tagungshotel steht ein begrenztes Zimmerkontingent bis vier Wochen vor der Veranstaltung zu einem ermäßigten Preis zur Verfügung. Bitte nehmen Sie die Reservierung direkt im Hotel unter dem Stichwort „Risk Research“ vor.

Ja, ich/wir nehme(n) teil

- | | |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Mathematisch-statistische Methoden der Kreditrisikomodellierung | 15.05.2023 |
| <input type="checkbox"/> Entwicklung von PD- und LGD-/EAD-Modellen | 16./17.05.2023 |
| <input type="checkbox"/> Kreditportfoliomodelle | 27./28.06.2023 |
| <input type="checkbox"/> Validierung interner Ratingsysteme | <input type="checkbox"/> 27./28.09.2023 <input type="checkbox"/> 27.09.2023 <input type="checkbox"/> 28.09.2023 |
| <input type="checkbox"/> Aufsichtsrechtliche Anforderungen an Ratingmodelle (PD und LGD) | 14./15.11.2023 |
| <input type="checkbox"/> Modellierung des Lifetime Expected Loss | 21.11.2023 |
| <input type="checkbox"/> Ausgestaltung der RTF in ökonomischer und normativer Perspektive | 22.11.2023 |

1. Teilnehmer/in

Name, Vorname _____
Funktion _____ Abteilung _____
Telefon _____ E-Mail _____
Firma, Anschrift _____

2. Teilnehmer/in [- 15%]

Name, Vorname _____
Funktion _____ Abteilung _____
Telefon _____ E-Mail _____

Ansprechpartner/in Personalabteilung/Sekretariat

Name, Vorname _____
Funktion _____ Abteilung _____
Telefon _____ E-Mail _____

Rechnungsadresse

Firma _____
Name, Vorname _____
Abteilung _____ E-Mail _____
Anschrift _____

Datum/Unterschrift _____

Teilnahmegebühren

Die Teilnahmegebühr für die zweitägigen **Präsenz-Workshops** beträgt 1.790 EUR und für die Einzeltags-Buchungen 990 EUR. Dem zweiten Teilnehmenden eines Unternehmens werden 15% Preisnachlass auf die jeweilige Teilnahmegebühr gewährt. Ermäßigungen für weitere Teilnehmende auf Anfrage. Frühbuchererrabatte finden Sie auf den Innenseiten bei dem jeweiligen Präsenz-Workshop. Die Teilnahmegebühr für den **Online-Workshop** beträgt 690 EUR für den ersten Teilnehmenden eines Unternehmens. Alle weiteren Teilnehmenden eines Unternehmens zahlen 390 EUR/Person. Die Teilnahmegebühr für den Workshop „Mathematisch-statistische Methoden der Kreditrisikomodellierung“ beträgt 790 EUR, bei gemeinsamer Buchung mit einem der anderen Workshops 690 EUR.

Im Preis inbegriffen sind die Workshopunterlagen sowie das Mittagessen und die Getränke (während der Präsenz-Workshops). Der Online-Workshop findet über Zoom statt. Der Zugangslink wird einen Werktag vor der Veranstaltung per E-Mail verschickt. Alle Preise verstehen sich pro Person und zzgl. 19% USt.

Teilnahmebedingungen

Nach Eingang der Anmeldung erhalten Sie eine Bestätigung, etwa zwei Wochen vor der Veranstaltung die Rechnung. Die Teilnahmegebühr ist nach dem Erhalt der Rechnung fällig. Die Stornierung ist bis 40 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenlos möglich. Bei Annullierung bis zum vierzehnten Tag vor Veranstaltungsbeginn wird die Hälfte der Teilnahmegebühr erhoben. Bei Absagen nach dem vierzehnten Tag wird der gesamte Betrag in Rechnung gestellt. Selbstverständlich ist eine Vertretung des angemeldeten Teilnehmenden jederzeit möglich. Ferner behält sich der Veranstalter vor, Programmänderungen aus dringendem Anlass vorzunehmen sowie die Veranstaltung aus zwingenden Gründen abzusagen bzw. zu verlegen.

Ihre Daten

Verantwortlicher für diese Datenerhebung ist die Risk Research GmbH. Ihre im Anmeldeformular übermittelten Daten werden zur Erbringung vertraglicher Leistungen erhoben (Art. 6 Abs. 1 lit. b DSGVO), wie auch ggf. auf Basis Art. 6 Abs. 1 lit. a, c und f DSGVO, um eine reibungslose Abwicklung unserer Workshops zu gewährleisten. Weitere ausführliche Angaben, insbesondere zu Betroffenen- und Widerrufsrechten, zur Speicherdauer Ihrer Daten, zu Grundsätzen der Datenweitergabe und zur Verfügung stehenden Kontaktdaten unseres Datenschutzbeauftragten finden Sie auf unserer Homepage (risk-research.de/datenschutz-workshop).

Veranstaltungsticket der Deutschen Bahn

Für Ihre An- und Abreise können Sie ein **Veranstaltungsticket der Deutschen Bahn zum Festpreis** beziehen. Weitere Informationen hierzu finden Sie auf unserer Homepage unter risk-research.de/workshops