

16. Operational Risk Quant- & Research- Workshop

29. Januar 2020, 10:00 – 16:30 Uhr

Bank-Verlag GmbH, Wendelinstraße 1, 50933 Köln

Agenda

- 09.30 – 10.00 Registrierung
- 10.00 – 10.20 Begrüßung, Vorstellungsrunde der Teilnehmer
Rainer Sprengel / Dr. Patrik Buchmüller, Teilnehmer
- 10.20 – 12.00 Die Umsetzung des neuen OpRisk-Standardansatzes in der EU und weitere Inhalte
des EBA Advice zu OpRisk
Frank Corleis BaFin
- Aktuelle Entwicklungen im Bereich IT-Risiken
Dr. Jens Gampe BaFin
- 12.00 – 13.30 Mittagessen / Networking
- 13:30 – 14.30 BaFin Merkblatt zu Nachhaltigkeitsrisiken: Konsequenzen für die Risikosteuerung
Dr. Patrik Buchmüller, Universität Tübingen
- Die Datenlage zu Nachhaltigkeitsrisiken im Finanzsektor
Petra Ludwig, VöB-Service
- 14:30 – 15.15 Risikobewertung bei hohen Quantilen: Konstruktion von Tail-Modellen und
die Herausforderungen im OpRisk-Bereich
Prof. Dr. Christoph J. Börner / Dr. Ingo Hoffmann,
Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf
- 15.15 – 15.45 Kaffee-Pause
- 15:45 – 16:15 Diskussion mit Teilnehmerbeiträgen zu den Themen Risikomodellierung in Säule II;
Einbeziehung der IT-Risikolage in die Säule II, Quantifizierung und Fortentwicklung
der Steuerung der Säule II Risiken sowie weiteren Themen
- 16:15 – 16.30 Planung des nächsten Workshops / Ende der Veranstaltung

Rainer Sprengel & Dr. Patrik Buchmüller

Deutsche Gesellschaft für Operational Risk Management e.V.
(Kooperationspartner des Institute of Operational Risk)

Stand: 28. Januar 2020, Änderungen vorbehalten