

# Gesamtbanksteuerung 2018

Geschäftsmodelle | Finanz- und Risikomanagement | Digitale Innovation

6. Jahreskonferenz am 26. April 2018 auf  
dem neuen Campus der Frankfurt School of Finance & Management



## Am Programm wirken u. a. mit:

- **Dr. Marcus Chromik**, Commerzbank AG
- **Prof. Dr. Thomas Heidorn**, Frankfurt School of Finance & Management
- **Prof. Dr. Andreas Igl**, Hochschule der Deutschen Bundesbank
- **Fredun Mazaheri**, HSBC Deutschland
- **Dr. Johannes-Jörg Riegler**, BayernLB
- **Dr. Cornelius Riese**, DZ BANK AG
- **Raimund Röseler**, BaFin
- **Dr. Gernot Stania**, European Central Bank

Hauptkooperationspartner:



THE  
POWER  
TO KNOW.

Kooperationspartner:

**Deloitte.**

# Gesamtbanksteuerung 2018

Geschäftsmodelle | Finanz- und Risikomanagement | Digitale Innovation

Im April 2018 findet an der Frankfurt School of Finance & Management zum sechsten Mal die Jahreskonferenz „Gesamtbanksteuerung“ statt. Unsere Veranstaltung hat sich in den letzten Jahren als hochrangige Informations- und Gesprächsplattform etabliert: Branchenteilnehmer aus dem gesamten deutschsprachigen Raum nutzen diesen Fachevent, um sich über aktuelle Einflussgrößen und Handlungsfelder der Gesamtbanksteuerung zu informieren und sich mit anderen Führungskräften aus Finanzsektor und Aufsicht sowie mit Vertretern der Wissenschaft auszutauschen.

Im Mittelpunkt unserer Konferenz steht die Frage, wie sich die Anforderungen der Bankenaufsicht und des Marktumfeldes auf

Risikosteuerung, Kapitalmanagement und Geschäftsmodelle der Kreditinstitute auswirken und welche neuen Entwicklungen sich in diesen Feldern abzeichnen. Eng damit verbunden sind aktuelle Fragestellungen der Architektur und Infrastruktur von Banken, die aus verschiedenen Perspektiven diskutiert werden.

Nutzen Sie unsere Konferenz, um sich im Kollegenkreis über die neuen Anforderungen, Strategien und Lösungsansätze der Gesamtbanksteuerung auszutauschen. Wir laden Sie herzlich ein, an unserer Veranstaltung teilzunehmen, und freuen uns auf interessante, anregende Fachgespräche und Diskussionen.



**Prof. Dr. Thomas Heidorn**

Leiter Centre for Practical Quantitative Finance  
Frankfurt School of Finance & Management



**Ulrich Martin**

Leiter Konferenzen und Marketing  
Frankfurt School Verlag



**Die Konferenz auf Twitter:  
#GBANKS2018**

## Diskutieren Sie mit den Sprechern und Gästen die folgenden Fragen:

- Wie verändern Basel, CRD & Co. die Gesamtbanksteuerung?
- Bankenkonsolidierung pro und contra: Welche Fusionen ergeben Sinn?
- Die Bank von morgen: (wie) wandeln sich die Strukturen von Ergebnis, Risiko und Kapitalisierung?
- Wie viel „Luft“ ist noch beim Provisionsergebnis – und wo sind die Grenzen?
- Aktuelle Stresstests: welche Konsequenzen ergeben sich für Balance Sheet und Geschäftsmodelle?
- Interne Risikomodelle auf dem Prüfstand: was bringt TRIM?
- Digitalisierung der Gesamtbanksteuerung: Welche Chancen bieten Big Data, Analytics und Machine Learning?
- Haben wir im Zeitalter neuer Technologien die passende Bankenregulierung?
- Und haben wir im Zeitalter neuer Regulierung die passende Bankentechnologie?
- Was bedeutet Künstliche Intelligenz für die Zukunft von (Finanz-)Unternehmen?

# Agenda

---

Gesamtmoderation: **Prof. Dr. Thomas Heidorn**, Leiter Centre for Practical Quantitative Finance, Frankfurt School of Finance & Management

---

**Ab 8:30 Uhr** EMPFANG UND AUSGABE DER KONFERENZUNTERLAGEN

---

**9:15–9:30 Uhr** **Eröffnung**  
**Klaus Beinke**, Geschäftsführer Frankfurt School Verlag, efiport GmbH, und Vizepräsident der Frankfurt School of Finance & Management  
**Prof. Dr. Nils Stieglitz**, Professor für Strategic Management und Präsident der Frankfurt School of Finance & Management (ab 01.04.2018)

---

**9:30–9:40 Uhr** **Einführung in den Konferenztag**  
**Prof. Dr. Thomas Heidorn**, Leiter Centre for Practical Quantitative Finance, Frankfurt School of Finance & Management

---

**9:40–10:10 Uhr** **Eigenkapitalsteuerung, Risikomanagement, Interne Modelle: Aktuelle bankaufsichtliche Entwicklungen und Schwerpunkte**  
**Raimund Röseler**, Exekutivdirektor Bankenaufsicht, BaFin

---

**10:10–10:40 Uhr** **Banksteuerung und Konsolidierung im aktuellen Marktumfeld**  
**Dr. Cornelius Riese**, Mitglied des Vorstands, Chief Financial Officer, DZ BANK AG

---

**10:40–11:10 Uhr** **Zusammenspiel von Bankenaufsicht und Wettbewerb – Ein Plädoyer für einen pragmatischen Umgang**  
**Dr. Johannes-Jörg Riegler**, Vorsitzender des Vorstands der BayernLB und Präsident des Bundesverbandes Öffentlicher Banken

---

**11:10–11:40 Uhr** PAUSE UND NETWORKING

---

**11:40–12:10 Uhr** **Digitalisierung im Risikomanagement von Banken – welche Chancen bieten Big Data, Analytics und Machine Learning?**  
**Fredun Mazaheri**, Mitglied des Vorstands, Chief Risk Officer, HSBC Deutschland

---

**12:10–12:40 Uhr** **Haben wir im Zeitalter neuer Technologien die passende Regulierung?**  
**Dr. Marcus Chromik**, Mitglied des Vorstands, Chief Risk Officer, Commerzbank AG

---

**12:40–13:25 Uhr** **Podiumsdiskussion:**  
**Europäischer Bankenmarkt unter Veränderungsdruck: (wie) wandeln sich die Strukturen von Ergebnis, Risiko und Kapitalisierung?**  
**Dr. Marcus Chromik**, Mitglied des Vorstands, Chief Risk Officer, Commerzbank AG | **Fredun Mazaheri**, Mitglied des Vorstands, Chief Risk Officer, HSBC Deutschland | **Dr. Cornelius Riese**, Mitglied des Vorstands, Chief Financial Officer, DZ BANK AG | **Dr. Johannes-Jörg Riegler**, Vorsitzender des Vorstandes der BayernLB und Präsident des Bundesverbandes Öffentlicher Banken | **Raimund Röseler**, Exekutivdirektor Bankenaufsicht, BaFin | **Prof. Dr. Thomas Heidorn**, Leiter Centre for Practical Quantitative Finance, Frankfurt School of Finance & Management (Moderation)

---

**13:25–14:15 Uhr** GEMEINSAMES MITTAGESSEN

---

14:15–14:40 Uhr **The Analytical CRO – moving from “what is” to “what if”**   
**Troy Haines**, Head of Risk Research & Quantitative Solutions, SAS

14:40–14:45 Uhr PAUSE FÜR RAUMWECHSEL

14:45–16:15 Uhr **Parallele Themenfokusreihen**

**THEMENFOKUS I: Die aktuellen Stresstests von EZB und EBA: Konsequenzen für die Gesamtbanksteuerung**

**Einleitung und Moderation:**

**Prof. Dr. Andreas Igl**, Professor für Bankbetriebslehre, Hochschule der Deutschen Bundesbank

**Zentrale Erkenntnisse der neueren Stresstests und mögliche künftige Schwerpunktbereiche**

**Dr. Gernot Stania**, Head of Quantitative Risk Analysis Section, Micro-Prudential Supervision IV, European Central Bank

**Aus Stresstests lernen: Optimierungsansätze für Balance Sheet und Geschäftsmodelle**

**Dr. Erik Lüders**, Partner, Head of Strategic Risk, Deloitte

**Podiumsdiskussion**

- **Ronny Hahn**, Bereichsleiter Risiko Controlling, Aareal Bank AG
- **Frank Müller**, Partner, Financial Risk, Deloitte
- **Dr. Gernot Stania**, Head of Quantitative Risk Analysis Section, Micro-Prudential Supervision IV, European Central Bank
- **Robert Stindl**, Director Risk Solutions North-EMEA, SAS

**THEMENFOKUS II: Model Risk Management als Instrument der Gesamtbanksteuerung im Kontext von TRIM und anderen neuen Entwicklungen**

**Einleitung und Moderation:**

**Prof. Dr. Thomas Heidorn**, Leiter Centre for Practical Quantitative Finance, Frankfurt School of Finance & Management

**Modellrisiko vor dem Hintergrund des SREP**

**Dr. Carsten Wehn**, Leitung Modellvalidierung, DekaBank

**Digitalisierung – Segen oder Fluch für Modellierung und Modellrisiken?**

**Ansgar Finken**, Bereichsleiter Konzernrisikocontrolling, Deutsche Postbank AG

**Podiumsdiskussion**

- **Ansgar Finken**, Bereichsleiter Konzernrisikocontrolling, Deutsche Postbank AG
- **Dr. Christopher Lotz**, Leiter der Abteilung Quantitative Risikomodellierung, BaFin
- **Matthias Piston**, Business Expert Risk Management, SAS
- **Dr. Carsten Wehn**, Leitung Modellvalidierung, DekaBank

16:15–16:30 Uhr PAUSE FÜR RAUMWECHSEL UND NETWORKING

16:30–17:00 Uhr **The Rise of Artificial Intelligence – why this time is different**

**Prof. Dr. Gregory Wheeler**, Professor für Philosophie und Informatik, Leiter Philosophy & Law Department, Frankfurt School of Finance & Management

17:00 Uhr **Zusammenfassung des Tages und Ausblick**

**Prof. Dr. Thomas Heidorn**, Leiter Centre for Practical Quantitative Finance, Frankfurt School of Finance & Management

im Anschluss GET-TOGETHER UND FORTSETZUNG DER DISKUSSION

# Die Sprecher der Konferenz



**Dr. Marcus Chromik** ist seit Januar 2016 Mitglied des Vorstands der Commerzbank und verantwortlich für das Risikomanagement des Konzerns. Der promovierte Kernphysiker war zuvor bei der Postbank tätig, wo er zuletzt für die Liquiditätssteuerung und das Credit Treasury verantwortlich war. Seine berufliche Laufbahn begann er 2001 bei McKinsey.



**Ansgar Finken** ist Bereichsleiter Konzernrisikocontrolling der Deutschen Postbank AG und u.a. verantwortlich für Risikomodelle, Kreditportfoliosteuerung und Modellrisiken sowie strategische und regulatorische Transformationsvorhaben. Zuvor war er in der Deutschen Bank in diversen Funktionen des Risikomanagements im Retail und Investment Banking tätig.



**Ronny Hahn** leitet bei der Aareal Bank den Bereich Risiko Controlling und ist u.a. für die Risikomodelle, den ICAAP, ILAAP und die Risikoberichterstattung verantwortlich. Vor seiner Tätigkeit für die Aareal Bank war er langjähriger Berater im Bereich Risikomanagement und Aufsichtsrecht.



**Troy Haines** is Head of the Risk Research and Quantitative Solutions Division at SAS. He is responsible for strategic direction, applied research, product management, and delivery of financial risk management initiatives worldwide. Prior Haines was Head of Mortgage Banking Risk Modeling and Analytics at JPMorgan Chase.



**Prof. Dr. Thomas Heidorn** ist Professor für Bankbetriebslehre an der Frankfurt School of Finance & Management. Dort leitet er das Centre for Practical Quantitative Finance und forscht hauptsächlich in den Bereichen Capital Markets, Markt- und Kreditrisiko sowie ALM. Zuvor war er u.a. für die Deutsche Bundesbank und die Dresdner Bank tätig.



**Prof. Dr. Andreas Igl** ist Professor für Bankbetriebslehre an der Hochschule der Deutschen Bundesbank in Hachenburg. Dort forscht er hauptsächlich in den Bereichen Gesamtbanksteuerung, Stresstest, SREP sowie der Sanierung und Abwicklung von Banken. Zuvor war er u.a. als geschäftsführender Partner in der Beratungsbranche tätig.



**Dr. Christopher Lotz** leitet bei der BaFin die Abteilung Quantitative Risikomodellierung und ist zuständig für die Beaufsichtigung von internen Risikomodellen bei Banken, Versicherungen und zentralen Kontrahenten. Zuvor war er bei der Deutschen Bank und der EZB tätig und dort verantwortlich für die Validierung von Bewertungs- und Risikomodellen.



**Dr. Erik Lüders** ist Partner im Bereich Risk Advisory von Deloitte. Sein Verantwortungsbereich umfasst Risikomanagement bei Finanzinstituten. Er berät führende Finanzinstitute global zu Gesamtbanksteuerung und Risikothemen. Vor seiner Tätigkeit bei Deloitte war er für einen Strategieberater und einen weiteren Big 4 tätig.



**Fredun Mazaheri** verantwortet seit Mai 2017 das Vorstandsressort Risikomanagement bei HSBC Deutschland. Mazaheri kommt von der Commerzbank, wo er als Bereichsvorstand das Risk-Controlling und das Capital Management leitete und Mitglied des bankweiten Kreditkomitees war. Davor arbeitete er als Strategieberater bei der Boston Consulting Group.



**Frank Müller** ist Partner im Bereich Risk Advisory von Deloitte. Sein Verantwortungsbereich umfasst quantitative Methoden im Risikomanagement, darunter insbesondere ICAAP und Stress-testing. Zuvor war er bei einer weiteren Big 4-Gesellschaft in der prüfungsnahen Beratung sowie im Risikocontrolling einer Frankfurter Großbank tätig.



**Matthias Piston** war über 7 Jahre für PwC tätig. Er hat zahlreiche Banken in der Basel II-Umsetzung und IRBA-Zulassung beraten und zuletzt die aufsichtsrechtliche Prüfung bei einer deutschen Großbank geleitet. Er ist Risk Business Expert bei SAS North-EMEA und unterstützt Kunden bei der Konzeption von modernen Infrastrukturen für BCBS 239.



**Dr. Johannes-Jörg Riegler** ist seit 2014 CEO der BayernLB. Zuvor war er u.a. CRO und stv. Vorstandsvorsitzender der NordLB, CRO bei der Westfalenbank (HVB-Gruppe) sowie für die Deutsche Bank tätig. Riegler ist Honorarprofessor an der Leuphana Universität Lüneburg und seit November 2016 Präsident des Bundesverbandes Öffentlicher Banken.



**Dr. Cornelius Riese** ist seit 2013 Mitglied des Vorstands der DZ BANK AG, zuständig für Finanzen und Strategie. Im Juli 2017 wurde er zum Co-Vorstandsvorsitzenden der DZ BANK mit Wirkung zum 1. Januar 2019 berufen. Bevor er 2009 zur DZ BANK kam, hatte Cornelius Riese Managementpositionen bei DG HYP und Accenture inne.



**Raimund Röseler** ist Exekutivdirektor des Geschäftsbereichs Bankenaufsicht der BaFin sowie Mitglied im Board of Supervisors der European Banking Authority in London. Zuvor bekleidete er als Referats- und Abteilungsleiter verschiedene Positionen innerhalb der BaFin und war u.a. für den AXA Konzern, den DSGVO sowie die Bayerische Vereinsbank tätig.



**Gernot Stania** is a member of the ECB Banking Supervision and Head of the Quantitative Risk Analysis Section. His team is responsible for horizontal stress test matters, including methodological aspects, design and implementation of quality assurance approaches and horizontal analyses. Mr. Stania holds a PhD in experimental physics.



**Robert Stindl** studierte BWL an der WU Wien. Innerhalb der Unicredit Group war er in der Architekturdefinition und Projektleitung tätig. Bei SAS DACH führte er den Bereich Business Solutions in den Themenfeldern Risk-, Customer-, Analytical- und Financial Intelligence. Heute leitet er als Head of Risk Solutions den Bereich North-EMEA von SAS.



**Dr. Carsten S. Wehn** leitet bei der DekaBank die Einheit Modellvalidierung und ist für die Validierung der Bewertungsmodelle sowie der Risikomodelle verantwortlich. Vor seiner Tätigkeit für die DekaBank war er bei der Deutschen Bundesbank für bankaufsichtsrechtliche Prüfungen zuständig.

Anmeldung per Fax: 069/154008-657  
oder online: [www.fs-verlag.de/gbs](http://www.fs-verlag.de/gbs)

#### Fokussierter Teilnehmerkreis

Die Anmeldung zu dieser Konferenz ist folgenden Teilnehmergruppen vorbehalten:

- Fach- und Führungskräfte aus Kreditinstituten
- Mitarbeiter von Kanzleien und Wirtschaftsprüfungsgesellschaften
- Vertreter von Bankenverbänden und Regierungsorganisationen
- Hochschulvertreter (in hauptberuflicher Tätigkeit)
- Teilnehmer von Masterstudiengängen mit Fachbezug

#### Aktuelle Literatur:



Ahmed Baycan  
**M&A im Bankensektor – Bedeutung und Auswirkungen des Inhaberkontrollverfahrens**  
1. Auflage 2018, 114 Seiten, Broschur  
ISBN 978-3-95647-126-1, 39,90 EUR  
**Erscheint im Februar 2018.**



Andreas Igl / Marcel Krüger / Christian Stepanek / Sven Warnecke (Hg.)  
**Bankenabwicklung und MREL**  
1. Aufl. 2018, ca. 350 Seiten, Broschur  
ISBN 978-3-95647-105-6, ca. 69,90 EUR  
**Erscheint im 2. Quartal 2018.**

#### Ja!

- Ich nehme an der Konferenz „Gesamtbanksteuerung 2018“ am 26. April 2018 teil (495,00 EUR zzgl. 19 % MwSt.)
- Ich nehme zum Frühbuche Preis (395,00 EUR zzgl. 19 % MwSt.) an der Konferenz „Gesamtbanksteuerung 2018“ teil (bei Anmeldung bis spätestens zum 5. März 2018).

#### Teilnahme an den parallelen Vortragsreihen

Ich besuche voraussichtlich

- Themenfokusreihe I     Themenfokusreihe II

- Ich bestelle das Buch „M&A im Bankensektor“ (39,90 EUR zzgl. Versandkosten).
- Ich bestelle das Buch „Bankenabwicklung und MREL“ (ca. 69,90 EUR zzgl. Versandkosten).

Geschäftlich     Privat (Verbraucher)

Name, Vorname
Firmenname
Position, Abteilung
Straße/Postfach
PLZ/Ort
Telefon/Fax
E-Mail
Datum, Unterschrift

Teilnahmebedingungen: Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung mit Rechnung. Bitte zahlen Sie die Teilnahmegebühr direkt nach Erhalt der Rechnung. Die Teilnahmegebühr versteht sich zzgl. 19 % MwSt. Der Preis beinhaltet die Teilnahme an allen Vorträgen der Veranstaltung, Mittagessen, Kaffeepausen sowie die Konferenzunterlagen. Bis zum 2. April 2018 können Sie kostenlos stornieren. Bei Stornierung der Anmeldung zu einem späteren Zeitpunkt oder bei Nichterscheinen berechnen wir die volle Teilnahmegebühr; selbstverständlich ist eine Vertretung für angemeldete Teilnehmer möglich. Wir weisen darauf hin, dass Name, ggf. Firmenbezeichnung und Ort aller Teilnehmer in einer Teilnehmerliste aufgeführt werden, die am Veranstaltungstag zu Informationszwecken der Gäste aushängt, und dass während des Konferenztages fotografische Aufnahmen gemacht werden, die nach der Veranstaltung veröffentlicht werden. Programmänderungen vorbehalten.

#### Veranstaltungsort:

Frankfurt School of Finance & Management, Adickesallee 32–34, 60322 Frankfurt am Main

#### Kontakt:

Frankfurt School Verlag, Telefon: 069/154008-646; E-Mail: [info@frankfurt-school-verlag.de](mailto:info@frankfurt-school-verlag.de)  
(Eine Anfahrtbeschreibung finden Sie auf unserer Website [www.frankfurt-school-verlag.de](http://www.frankfurt-school-verlag.de) unter Kontakt)