

Nähere Infos zu aktuellen Büchern und Seminaren für

- Banken
- Versicherungen
- Finanz-/Wertpapierdienstleister und
- beratende Berufe:

[www.finanzenverlag.at](http://www.finanzenverlag.at)

## ANMELDUNG/BESTELLUNG/VORABFRAGEN:

Fax (01) 713 53 34-85, E-Mail: [buschek@finanzverlag.at](mailto:buschek@finanzverlag.at)

Ich melde mich verbindlich zu „PRIIPs konkret“ am 23. Mai 2019 an:

- zum regulären Preis EUR 552,- (exkl. 20% MwSt)  zum Sonderpreis (VÖIG o. Bankenverband) EUR 512,- (exkl. 20% MwSt)

Sonderpreis für Mitglieder von **VÖIG oder Bankenverband!** Im Seminarbeitrag sind Mittagessen, Kaffeepausen mit Imbiss und Getränken sowie die umfangreiche Arbeitsmappe und Schreibunterlagen enthalten.

\_\_\_\_\_  
Titel, Name Teilnehmer(in)

\_\_\_\_\_  
Unternehmen / Position im Unternehmen

\_\_\_\_\_  
Straße PLZ Ort

\_\_\_\_\_  
e-mail Telefon

\_\_\_\_\_  
Datum Unterschrift

**Anmeldung:** Finanzverlag/Kitzler-Verlag GmbH, Uraniastraße 4, 1010 Wien, Fax: (01) 713 53 34 DW 85, Tel: (01) 713 53 34-21 (Fr. Dr. Buschek), e-Mail: [buschek@finanzverlag.at](mailto:buschek@finanzverlag.at). Der Seminarbeitrag beinhaltet Mittagessen, Kaffeepausen mit Imbiss, Getränke, umfangreiche Arbeitsmappe und Schreibunterlagen! Mit der Anmeldebestätigung erhalten Sie eine Rechnung, die Sie bitte vor Seminarbeginn begleichen. **Datenschutz:** Die von Ihnen angegebenen Adressdaten werden ausschließlich zur Veranstaltungsvorbereitung und -abwicklung verarbeitet. Wenn Sie die Anmeldung für andere Personen vornehmen, gehen wir von Ihrer Berechtigung dafür aus. Weitere Infos: [www.finanzenverlag.at/Datenschutz](http://www.finanzenverlag.at/Datenschutz). **Storno:** Bitte haben Sie Verständnis: Bei Stornierung (oder Nichterscheinen) am Kurstag wird die volle Seminargebühr als Stornogebühr verrechnet. Diese Gebühr entfällt selbstverständlich bei Nennung einer Ersatzperson.

Abonnieren Sie den **kostenlosen Newsletter** des Finanzverlags durch Mail an [office@finanzverlag.at](mailto:office@finanzverlag.at)!

 finanzverlag

**Erfahrungen,  
Auslegungen d. Aufsicht,  
neue Entwicklungen.**

**JETZT  
ANMELDEN!**

# PRIIPs konkret!

## Anforderungen/Erfahrungen/Lösungen

### Informieren Sie sich topaktuell:

- **Antworten** für betroffene Institute betreffend die Anforderungen und viele herausfordernde **technische Fragestellungen** (zB Ermittlung von Marktrisiko-, Performance-Szenario- und Stress-Szenariowerten, variable Kupons, Kündigungsrechte, negative Zinsen, u.v.a.)
- Über ein Jahr **Praxiserfahrungen** mit dem 3-seitigen Dokument!
- Auslegung und Erfahrungsberichte der zuständigen **Aufsichtsbehörde**
- Formerfordernisse (Template), Darstellung der Produkt-Kostenstruktur, der Produkt-Risikostruktur, Warnhinweise, Aktualisierung, Bereitstellung, sonstige Anforderungen
- Rolle/Pflichten des **Herstellers** und Rolle/Pflichten des **Vertreibers**
- Verwaltungsrechtliche und zivilrechtliche **Sanktionen, Haftung**
- **Blick über die Grenzen:** aktuelle Entwicklungen auf Europäischer Ebene
- **Fallkonstellationen mit Auslandsbezug** (Hersteller im Drittland, Hersteller in anderem EU-MS, Übersetzung, Sprachenregime)
- **Marktüberblick** über PRIP-KIDs österreichischer Hersteller.

### Wer sollte teilnehmen?

- Banken, Versicherungen, Wertpapierdienstleister, KAGs, Anleiheemittenten
- Verantwortliche und Mitarbeiter: insbes. Compliance Officer, Interne Revision, Vertrieb, Risikomanagement, Geschäftsleitung, Back Office, u.a.
- Consulter, Interessenvertreter, Wirtschaftsprüfer, Rechtsanwälte.

### WANN?

**23. Mai 2019**

9.00 bis 17.00 Uhr

### WO?

**Hotel de France**

Schottenring 3, 1010 Wien

**VÖIG**

In Kooperation mit

**bankenverband**

Verband österreichischer  
Banken & Bankiers

## Programm:

09:00 - 12:30 **Mag. Roland Dämon / FMA,**  
**Mag. Ralph Rirsch, BSc. / FMA**

### **Packaged Retail and Insurance-Based Investment Products (PRIIPs)**

- Begrifflichkeiten
- Ausnahmen
- Pflichten des Herstellers / Verkäufers
- Anforderungen an das Basisinformationsblatt für Anlageprodukte
  - Gestaltung
  - Produktinformationen
  - Darstellung der Kostenstruktur der Produkte
  - Darstellung der Risikostruktur der Produkte
  - Warnhinweise
- Formerfordernisse des Basisinformationsblattes (Template)
- Vertriebsvorschriften
- Aktualisierungserfordernisse: - Periodisch; - Ad hoc
- Bereitstellung des Basisinformationsblattes
- Haftung des Herstellers
- Sanktionen
- aktuelle Aufsichtserfahrungen und Auslegungen der FMA
- aktuelle Entwicklungen auf Europäischer Ebene
- Fallkonstellationen mit Auslandsbezug (Hersteller im Drittland, Hersteller in anderem EU-MS, Übersetzung, Sprachenregime)

12:30 - 13:30 Mittagspause

### **Dr. Alice Mladenka / FMA**

#### **Marktüberblick über PRIIP-KIDs österreichischer Hersteller:**

- Wer bietet welche Produkte an?
- Welche Merkmale kennzeichnen die Produkte?
- Trends und Auffälligkeiten in den PRIIP-KIDs

15:00 - 17:00 **Dr. Andreas Binder/ MathConsult GmbH**  
**Dr. Michael Aichinger/ uni software plus GmbH**

### **Mathematisch-Technische Herausforderungen und Lösungsansätze für PRIIPs-KIDs**

Bei der Erstellung von PRIIPs KIDs für strukturierte Finanzinstrumente stellen die Teilaufgaben

- Ermittlung des Marktrisikowerts (market risk measure MRM) und
- Ermittlung der Performance-Szenario- und der Stress-Szenario-Werte in vielen Fällen erhebliche mathematische, algorithmische und informatische Herausforderungen dar. Fragen, die sich stellen, sind etwa:
  - Wie sind variable Kupons darzustellen?
  - Wie sind Kündigungsrechte zu behandeln?
  - Welche Fallen ergeben sich durch negative Zinsen?

## Referenten:

### **Mag. Roland Dämon / FMA**

*ist FMA-Experte für MiFID II, PRIIPs und verwaltungsbehördliche Aufsichtsverfahren mit Bezug auf Wertpapierfirmen und WPDLU. Er verfügt über eine abgeschlossene Rechtsanwaltsausbildung und ist seit Jahren mit Wertpapieraufsicht bei Banken und Wertpapierfirmen betraut. Er vertritt die FMA in internationalen Gremien und ist als Fachvortragender tätig.*



### **Mag. Ralph Rirsch, BSc. / FMA**

*ist Jurist in der Abteilung Integrierte Conduct- und Vertriebsaufsicht über Banken der österr. Finanzmarktaufsicht. Er ist zuständig für die behördliche Aufsicht im Bereich des WAG 2018 und der PRIIP-VO, sowie neue Technologien. Vor seiner Zeit bei der FMA war er als Unternehmensberater im österreichischen Bankensektor mit Fokus auf Aufsichtsrecht (e.g. MiFID II, PSD2), IT-Implementierungen und Datenbankmanagement tätig.*



### **Dr. Alice Mladenka / FMA**

*ist Spezialistin für Produkt- und Portfoliobewertung und -Modellierung; Studium der Techn. Mathematik an der TU Wien; Einsatz in der Kraftwerkseinsatzplanung und -Optimierung für Siemens AG Österreich, danach Entwicklung von Investmentstrategien, Bewertung von Finanzinstrumenten und Portfoliooptimierung; Seit 2008 in der FMA in der Abteilung Integrierte Finanzmärkte tätig.*



### **Dr. Andreas Binder / MathConsult GmbH**

*ist Mathematiker und seit 1996 Geschäftsführer der MathConsult GmbH, die Softwarelösungen für die produzierende Industrie und (unter dem Markennamen UnRisk) für die Finanzindustrie entwickelt. Er ist Autor von 3 Büchern zur Finanzmathematik und von über 30 Fachartikeln.*



### **Dr. Michael Aichinger / uni software plus GmbH**

*ist Physiker und seit 2014 Geschäftsführer der uni software plus GmbH, die Softwarelösungen für die produzierende Industrie und (unter dem Markennamen UnRisk) für die Finanzindustrie entwickelt. Er ist Autor von einem Buch zur Numerischen Finanzmathematik und von über 30 Fachartikeln.*



**Seminarbeitrag und Anmeldung UMSEITIG!**