



Dr. Andreas Igl, Henning Heuter, Sven Warnecke  
(Hrsg.)  
Handbuch SREP  
ISBN 978-3-86556-467-2  
Art.-Nr. 22.525-1600  
336 Seiten, gebunden  
69,00 EUR

### Highlights:

- ≡ Säule1+
- ≡ Rahmenwerk Szenario-Analysen + Stresstest
- ≡ Bankpraktische Vorbereitung der Geschäftsmodellanalyse
- ≡ Integrierte Liquiditätssteuerung im ILAAP

### Kurzbeschreibung:

Mit Einführung des neuen bankaufsichtlichen Überprüfungs- und Beurteilungsprozesses (SREP) Anfang 2016 stellen die europäischen Aufsichtsbehörden insbesondere deutsche Institute (direkt durch die EZB oder indirekt über die nationalen Aufsichtsbehörden BaFin und Bundesbank beaufsichtigt) vor neue Herausforderungen. Der regelmäßig durchzuführende SREP bezieht sich dabei auf die vier Prüfungsfelder „Geschäftsmodellanalyse“, „IKS und Governance“, „ICAAP“ sowie „ILAAP“. Eine fehlende Angemessenheit oder festgestellte Mängel führen unmittelbar zu SREP-Zuschlägen auf die aus der CRR bekannten aufsichtsrechtlichen Mindestanforderungen an das Kapital und die Liquidität, die die bestehenden Sanktionsmöglichkeiten aus der CRR ergänzen. In diesem Handbuch werden die Schwerpunkte des neuen Aufsichtsmodus erarbeitet. Die fortlaufende Bewertung eines Instituts auf Basis von (Schlüssel-)Indikatoren stellt dabei ein zentrales Element bei der „Industrialisierung“ der Bankenaufsicht dar. Eine stärkere Fokussierung auf gesamtbankweite Themenstellungen, wie Stresstest- und Szenario Analysen, die Compliance-Funktion oder die erhöhten Anforderungen an Konzentrations- und Modellrisiken, gehören ebenso dazu wie erste Erfahrungen aus der Prüfungspraxis. Zudem ist auch für die Säulen I und II, hinsichtlich des Kapitals (Säule 1+ im ICAAP) wie auch der Liquidität (integrierte Steuerung im ILAAP), eine stärkere Verzahnung als Folge der europäisch harmonisierten Anforderungen zu beobachten.

### Die Herausgeber

Dr. Andreas Igl, Dipl.-Wirtschaftsinformatiker (Univ.) Honors  
Henning Heuter, Dipl.-Bankbetriebswirt (BA) und Bankkaufmann  
Sven Warnecke, Bachelor of Science Zentralbankwesen/Central Banking

Zentrale Themen ihrer Beratungstätigkeit bei 1 PLUS i sind die Konzeption und Implementierung von Systemen zur Risikomessung und -steuerung sowie die Umsetzung von aufsichtsrechtlichen Anforderungen.

Das Handbuch ist erschienen im:

Bank-Verlag GmbH | Wendelinstraße 1 | 50933 Köln  
Kontakt: Ute Kolck | Telefon: +49-221-5490103 | Telefax: +49-221-5490316 | [www.bank-verlag.de](http://www.bank-verlag.de)

