

FINALISIERUNG VON BASEL III ODER BASEL IV?

DIE NEUEN ANFORDERUNGEN IM ÜBERBLICK

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>„Basel IV“ oder „Finalisierung von Basel III“, die quantitative Bankenaufsicht steht nicht still. Das Seminar bietet einen Überblick über die wichtigen, teilweise grundlegenden Änderungen auf Baseler und europäischer Ebene. Davon betroffen sind die Risikomessverfahren für die Ermittlung der Eigenmittelanforderungen für den Kreditrisiko-Standardansatz, den auf internen Ratings basierenden Ansatz (IRB), das Kontrahentenrisiko, die Marktpreisrisiken und die operationellen Risiken. Neben dem erheblichen Aufwand für die Banken bei der Implementierung gehen teilweise signifikante Modifikationen bei den Eingangsparametern sowie die Einführung eines Basel-III-Output-Floors mit den neuen Anforderungen einher.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ☰ Überblick über die anstehenden Anforderungen <ul style="list-style-type: none"> ● Gesamtüberblick der Solvenzanforderungen und Ansatzpunkte der Änderungen ● Aktueller Status der Konsultation, Entwürfe und Finalisierung der einzelnen Regelungen ● Output Floor und andere übergreifende Regelungen ☰ Der neue Kreditrisikostandardansatz <ul style="list-style-type: none"> ● Verfolgte Ziele ● Neue Risikogewichtsmethodik ● Änderungen bei den Kreditrisikominderungstechniken ☰ Überarbeitungen des auf internen Ratings basierenden Ansatzes (IRB) <ul style="list-style-type: none"> ● Einschränkungen des Anwendungsbereichs ● Einführung von Input Floors für die Verlustparameter PD, LGD und CCF ● Präzisierung der Anforderungen an die internen Schätzverfahren ☰ Neue Standardmethoden für Kontrahentenausfallrisiken und CVA-Risk Capital Charge <ul style="list-style-type: none"> ● Eingangsparameter und Berechnungsmethodik ● Berücksichtigung von Sicherheiten und Hedges ● Berechnungsbeispiele und Vergleichsrechnungen im Vergleich zu den bisherigen Methoden für die Risikoarten ☰ Neuerungen für Handelsgeschäfte (Fundamental review of the trading book - FRTB) <ul style="list-style-type: none"> ● Neue Abgrenzung des Handelsbuchs: Definition von Handelsbuchinstrumenten ● Rahmenbedingungen und Berechnungsmethodik des neuen Standardansatzes ● Berechnungsbeispiele und Vergleichsrechnungen zum aktuellen Ansatz ☰ Überarbeitung der Ansätze zur Ermittlung der Eigenkapitalanforderungen für operationelle Risiken <ul style="list-style-type: none"> ● Ablösung der drei existierenden Ansätze durch den Standardised Measurement Approach (SMA) ● Anpassungen beim Konzept des Business Indicators (BI) ● Einführung eines Internal Loss Multipliers (ILM) 	<p>KATEGORIE Aufsichtsrecht</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER A_13</p> <hr/> <p>SPEZIALISIERUNG</p> <p>Als Spezialisierung können alle Themengebiete des Seminars angeboten werden. Für spezielle Zielgruppen (z.B. IT-Mitarbeiter) können individuelle Veranstaltungen mit entsprechenden Schwerpunkten und Themengebieten zusammengestellt werden. Zur Vorbereitung auf bankaufsichtliche Prüfungen sind gesonderte Schulungsmaßnahmen möglich.</p>