

≡ KONTRAHENTENRISIKEN FÜR DERIVATE

EIGENMITTELANFORDERUNGEN AN BILATERALE UND ZENTRAL GECLEARTE DERIVATIVEGESCHÄFTE

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Ziel dieses Seminars ist es, einen Überblick über die Anforderungen zur Eigenmittelunterlegung sowohl von bilateralen als auch zentral geclearten Derivaten zu geben. Dabei sollen die aktuellen, aber auch anstehenden Überarbeitungen der Methoden zur Exposure-schätzung und die CVA-Charge als Unterlegungspflicht für das Risiko der Bonitätsverschlechterung des Kontrahenten behandelt werden.</p> <p>Neben der Befüllung der entsprechenden COREP-Meldebögen und der Durchführung von Berechnungsbeispielen ist ausreichend Freiraum für Diskussionen der Teilnehmer eingeplant.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Die Solvenzregelung im Überblick und Einordnung der Kontrahentenexposures ≡ Aktuelle aufsichtliche Grundlagen der CRR <ul style="list-style-type: none"> ● Laufzeitmethode ● Marktbewertungsmethode ● Standardmethode ● Neuer Standardansatz für Kontrahentenrisiken und europäische Varianten ● Interne Modelle Methode ≡ Kreditrisikominderungstechniken <ul style="list-style-type: none"> ● Netting und Collateral ≡ Credit Valuation Adjustment Risk Capital Charge (CVA-RCC) <ul style="list-style-type: none"> ● Grundlagen und Hintergründe ● Standard CVA-RCC und Advanced CVA-RCC ● Anstehende Neuerungen zur Berechnung der CVA-Risk Capital Charge ≡ Überblick über die neuen Anforderungen der Solvenzunterlegung für das Kontrahentenrisiko (CRR II) <ul style="list-style-type: none"> ● Der neue Standardansatz SA-CCR ● Aktueller Stand der Neuregelung des CVA-Risikos ≡ Solvenzvorschriften für Forderungen an CCP <ul style="list-style-type: none"> ● EMIR als neuer Rechtsrahmen für Derivate ● Clearingpflicht / Transaktionsregister / Risikomanagement ● Begriffsdefinition CCP/QCCP ● Handelsforderungen / Default Fund Exposure ≡ Regeln zur Kapitalunterlegung als Kunde / als Clearingmitglied <ul style="list-style-type: none"> ● Besonderheiten beim EAD , Risikogewicht ● Ermittlung Risikogewicht Default Fund 	<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_05</p>