

≡ SOLVABILITÄT – SCHWERPUNKT MARKTRISIKO

EIGENMITTELANFORDERUNGEN DER SÄULE 1

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Die aktuellen Eigenmittelanforderungen an das Marktrisiko für die Positionen des Handelsbuchs und FX- und Warenpositionen des Gesamtbuchs stellen den Schwerpunkt des Seminars dar.</p> <p>OTC-Geschäfte mit Derivaten unterliegen zudem den Kapitalanforderungen für das Kontrahenten- und das CVA-Risiko, die ebenfalls vorgestellt werden wie die Abwicklungsrisiken.</p> <p>Sie erhalten somit einen strukturierten Überblick über die derzeit anzuwendenden Solvenzregelungen. Eine Darstellung der zukünftig geltenden Richtlinien und die Methoden der Standardverfahren runden den Seminarinhalt ab.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Grundlagen der Solvenzanforderung für Handelsgeschäfte <ul style="list-style-type: none"> ● Überblick über die bankaufsichtlichen Regelwerke und Definition des Handelsbuchs ● Standardverfahren versus interne Modelle ● Bei Bedarf: Darstellung der Wirkungsweise von relevanten Handelsgeschäften und deren inhärente Risikoarten ● Überblick über die Standardverfahren und Zuordnung verschiedener Finanzinstrumente zu den einzelnen Adress-/Marktrisikopositionen ≡ Die Anforderungen an eine vorsichtige Bewertung von Handelsgeschäften (Prudent Valuation) ≡ Grundlegende Darstellung der Standardverfahren für die Marktrisiken <ul style="list-style-type: none"> ● Relevante Positionen, Berechnungsgrundlagen und -methoden zur Bestimmung der aufsichtlichen Eigenmittelunterlegung ● Fremdwährungsrisiken ● Rohwarenrisiken ● Positionsrisiken (= Zins- und Aktienrisiken im Handelsbuch): Unterlegung des allgemeinen und besonderen Risikos ● Berücksichtigung von Optionen in der Eigenmittelunterlegung ● Beispielrechnungen bis hin zum Meldebogen (ausgewählte Risikoarten) ≡ Adressrisiken für Handelsgeschäfte <ul style="list-style-type: none"> ● Kreditrisiko aus bilanziellen und außerbilanziellen Geschäften ● Gegenparteiausfallrisiko für Derivate ● Besondere Regelungen für Geschäfte mit zentralen Kontrahenten ● Abwicklungsrisiken ● CVA-Risk Capital Charge ≡ Weiterentwicklung der Solvenzanforderungen in der CRR/ „Basel IV“ <ul style="list-style-type: none"> ● Überarbeitung des Kontrahentenrisikoregimes (SA-CCR) ● Neuerungen zur CVA Risk Capital Charge ● Anpassungen in den Anforderungen zur Abgrenzung des Handelsbuches und der neue Standardansatz für das Marktpreisrisiko („FRTB“) 	<p>KATEGORIE Aufsichtsrecht</p> <p>G A P R</p>
		<p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p>
		<p>SEMINARNUMMER A_03</p>
		<p>SPEZIALISIERUNG</p> <p>Als Spezialisierung kann eine Vertiefung der Anforderungen an Interne Modelle für die aufsichtliche Eigenmittelunterlegung angeboten werden. Darin enthalten sind beispielsweise qualitative/ quantitative Anforderungen, Überblick über Risikomodellstandards, Beispielrechnungen, Validierung des Risikomodells, das grundsätzliche Prüfungsverfahren.</p>