

≡ SOLVABILITÄT – EIN ÜBERBLICK

DIE EIGENKAPITALUNTERLEGUNG VON KREDIT- UND MARKTRISIKEN SOWIE VERBRIEFUNGSPOSITIONEN

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Das Ziel des Seminars besteht darin, unter Berücksichtigung der aufsichtlichen Motive einen Gesamtüberblick über die regulatorische Solvenzsteuerung von Instituten zu vermitteln und dabei die aktuellen bzw. anstehenden Neuerungen kennen zu lernen. Dazu werden die Grundlagen der einzelnen Methoden für die Quantifizierung der Anrechnungsbeträge für Kredit-, Abwicklungs-, CVA- und Marktrisiken vorgestellt. Dies umfasst die Erläuterung der Standardmethoden sowie der Anforderungen für IRBA-Institute und Handelsbuchrisiken. Die Darlegung der Anforderungen für operationelle Risiken und der bestehenden Offenlegungspflichten für die erfassten Risiken rundet den Überblick ab.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Grundlagen der Solvenzanforderungen <ul style="list-style-type: none"> ● Motivation ● Einordnung in aufsichtliche Regelwerke ● Standardverfahren versus interne Modelle ≡ Eigenkapitalkomponenten und -quoten gemäß CRR (inkl. Output Floor) ≡ Behandlung von Adressausfallrisikopositionen <ul style="list-style-type: none"> ● Der Kreditrisikostandardansatz (KSA) ● Der auf internen Ratings basierende Ansatz (IRB) ≡ Kontrahentenrisiko-Positionen <ul style="list-style-type: none"> ● Methoden der Gegenparteilaisfallrisikomessung ● Zentraler Kontrahent (CCP) ● Trade Exposure und Default Fund (CCP) ● CVA-Risk Capital Charge ≡ Kreditrisikominderung <ul style="list-style-type: none"> ● Anerkannte Sicherheiten und Mindestanforderungen an Sicherheiten ● Bestimmung regulatorischer Sicherheitenwerte und Methodik zur Anrechnung von Sicherheiten ≡ Verbriefungen <ul style="list-style-type: none"> ● Definition Verbriefung inkl. Tranched Cover ● Überblick über Methoden zur Risikogewichtsableitung im KSA und IRB ≡ Behandlung von Marktpreisrisiken <ul style="list-style-type: none"> ● Aufsichtliche Anforderungen zur Differenzierung von Handels- und Bank-/Anlagebuch ● Abgrenzung von relevanten Risikoarten ● Standardverfahren zur Bestimmung der Eigenmittelanforderungen ≡ Operationelle Risiken ≡ Offenlegungspflichten 	<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_02</p> <hr/> <p>SPEZIALISIERUNG</p> <p>Als Spezialisierung können alle Themengebiete aus dem Bereich Aufsichtsrecht gewählt werden.</p>