

≡ GROÙE SPARKASSE - UMSETZUNG EZB-MELDEWESEN UND IMPLEMENTIERUNG CRR II (COREP)

Defect-Abarbeitung	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Bearbeitung offener Defects, insb. Abnahmeauflagen, Ablösung Workarounds 	AP1: SA-CCR	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Umfassende Überarbeitung der Standardansätze zur Quantifizierung des derivativen Kontrahentenausfallrisikos ≡ Die Bemessung des Risikopositionsbetrags erfolgt zukünftig durch den neuen Standardansatz SA-CCR anstelle der bisher verwendeten CEM ≡ Rohdatenlieferung versus (Teil-)Ergebnisdatenlieferung
Partial-Use	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Nutzung der Abacus-Funktionalität zur Generierung der Abdeckungsgradrechnung 	AP2: KMU-Faktor	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Die Überarbeitung führt dazu, dass sämtliche KMUs RWA-Erleichterungen erhalten. Die Ermittlung des KMU-Faktors basiert auf nachfolgender Formel:¹
Offenlegung	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Nutzung der Abacus-Funktionalität zur Befüllung der Offenlegungsbögen 	$\frac{\min\{E; \text{EUR } 2\,500\,000\} \cdot 0,7619 + \max\{E - \text{EUR } 2\,500\,000; 0\} \cdot 0,85}{E^*}$	
IP-Losses	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Nutzung der Abacus-Funktionalität zur Generierung der Hard-Test Kalkulationen 		
KSA-Test	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Gesamtportfolioanalyse Abweichungen KSA (Forderungsklassen, CCFs, Sicherheitenverteilung) 	AP3: NPE-Backstop	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Der maßgebliche Betrag der unzureichenden Deckung notleidender Risikopositionen ist vom harten Kernkapital abzuziehen ≡ Veröffentlichung neuer Template im Zuge von DPM3.0 ≡ Fragen zur Lizenzierung, Datenanforderungen, Überschneidungen FinRep
Weiterentwicklung interner Ratingmodelle	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Begleitung Weiterentwicklung interner Modelle aus Sicht CoRep (Re-Fit, MOC, Überführung Portfolien in IRB etc.) 	sonstiges	<ul style="list-style-type: none"> ≡ AP4: Behandlung CCP-Exposures ≡ AP5: Fondsdurchschau ≡ AP6: DPM3.0
Produktion	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Begleitung Produktion, Schulung Linie 		

¹ E* = insgesamt geschuldeter Betrag