



WEBINAR SA-CCR

HERAUSFORDERUNGEN IN DER IMPLEMENTIERUNG DES NEUEN STANDARDANSATZ FÜR COUNTERPARTY CREDIT RISK (SA-CCR)

BESCHREIBUNG

Nach der Finalisierung der CRR2 bleiben 2 Jahre Zeit, um die neue Standardmethode für das Gegenpartei-ausfallrisiko (SA-CCR) einzuführen und die bestehende Marktbewertungsmethode abzulösen.

Die Auswirkungen der neuen Methodik werden für die einzelnen Institute je nach Portfoliostruktur und Kundenstruktur völlig unterschiedlich sein.

Neben der Komplexität der neuen Berechnungsvorschrift stellt die Beschaffung bzw. Verfügbarkeit der für die Berechnung benötigten Inputdaten eine weitere Herausforderung dar.

Die Webinar-Teilnehmer erhalten einen Überblick über die neue Standardmethode SA-CCR. Die Inputgrößen und die wesentlichen Komponenten zur Berechnung werden vorgestellt sowie an Beispielen im Vergleich zur aktuellen Marktbewertungsmethode erläutert.

ZIELGRUPPE

Das Webinar richtet sich an Mitarbeiter im Meldewesen, Risikocontrolling, sowie an Markt- und Handelsabteilungen von Banken mit mittlerem und großem Derivate-Portfolio.

Inhalte

- Überblick über die Änderungen im Gegenpartei-ausfallrisiko im CRR-Entwurf
- Die aktuelle Marktbewertungsmethode
- Der neue Standardansatz SA-CCR
 - Wiedereindeckungsaufwand (RC) und potenzielle künftige Risikoposition (PFE)
 - Margined / Unmargined Berechnung
 - Nettingsatz / Hedgingsatz / Referenz
 - Inputparameter
- Beispiele

VORAUSSETZUNGEN

Grundkenntnisse zu Derivaten sind wünschenswert.

TERMINE

Montag, den **03.12.2018, 16:00 Uhr bis 17:30 Uhr**

ANMELDUNG

per E-Mail an training@sks-group.eu

REFERENTIN



Dr. Carola Blömer

Senior Manager

E-Mail: carola.bloemer@sks-group.eu

Mobil: +49 162 28 62 014