

vdpPfandbriefAkademie-Webinar

CRR II - Neue Standardansätze für das Kontrahentenrisiko (SA-CCR) – zweitägiges Webinar

WEBINAR – den Link zum virtuellen Raum, erhalten Sie wenige Tage vor Veranstaltungsbeginn

14. & 15. September 2020, 10:00 – 13:00 Uhr

Referent: Michael Kratochwil (Senior Manager, Dr. Nagler & Company GmbH)

Moderator: Dr. Uwe Gaumert (Verband deutscher Pfandbriefbanken e.V. (vdp))

Der Fokus des Workshops liegt auf den neuen regulatorischen Vorgaben für die Bestimmung der Eigenkapitalanforderungen für Derivate. Hierbei werden ausschließlich die neuen regulatorischen Standardansätze zur Exposure-Ermittlung behandelt. Ein weiterer Schwerpunkt des Workshops liegt auf den Einsatzmöglichkeiten des SA-CCR für Aspekte der Säule II (ökonomische Steuerung, Limitierung, etc.).

Mit der CRR II werden die bestehenden Ansätze (insb. Marktbewertungsmethode (CEM) und Ursprungsrisikomethode (OEM)) durch drei neue regulatorische Standardansätze abgelöst (SA-CCR, vereinfachter SA-CCR, überarbeitete OEM). Somit müssen Institute spätestens bis zum ersten relevanten Meldestichtag (30.06.2021) mindestens einen der genannten neuen Standardansätze umsetzen. Insbesondere der SA-CCR ist deutlich komplexer als die bestehenden Ansätze und mit höheren Datenanforderungen verbunden.

Tag 1 – 14. September 2020

09:45 – 10:00	Online Registrierung
10:00 – 10:15	Begrüßung, Einführung und Überblick
10:15 – 10:45	Einordnung des SA-CCR in das regulatorische Rahmenwerk und aktueller Stand der aufsichtlichen Diskussion
10:45 – 11:45	Detaillierte Darstellung und Diskussion der Berechnungsmethodik des SA-CCR und der vereinfachten Ansätze gem. CRR II (Aufbau und methodische Grundlagen, Komponenten, vereinfachter SA-CCR, OEM)
11:45 – 12:00	Pause
12:00 – 12:45	Analyse und Vergleich bestehender und zukünftiger Ansätze anhand von Beispielrechnungen für hypothetische Portfolien
12:45 – 13:00	Q & A

Tag 2 – 15. September 2020

09:45 – 10:00	Online Registrierung
10:00 – 10:15	Begrüßung und Wrap-up
10:15 – 10:45	Wechselwirkungen der SA-CCR Einführung mit anderen regulatorischen Aspekten (insb. Leverage Ratio)
10:45 – 11:30	Praktische Aspekte der SA-CCR Implementierung (Datenanforderungen, fachliche / technische Herausforderungen, Lessons learned)
11:30 – 11:45	Pause
11:45 – 12:30	Diskussion von Einsatzmöglichkeiten des SA-CCR für Aspekte der Säule II (ökonomisches Kapital, Limitierung Pricing)
12:30 – 13:00	Q & A