

Praxisseminar SA-CCR

Derivatepositionen unter CRR II (COREP-Meldungen)

www.exbase.de/saccr

Im Seminar erfahren Sie, wie Sie nach dem neuen Standardansatz Derivatepositionen regulatorisch bewerten und in COREP-Meldungen berücksichtigen. Der neue Standardansatz, die wichtigsten Parameter und die Berechnung von Derivatepositionen werden anhand einfacher und praxisnaher Beispiele vermittelt. Einen weiteren Schwerpunkt bildet das Mapping von Transaktionen zu Risikoklassen und Hedgingsets gemäß RTS 2019-02.

AGENDA

TEIL 1 (08.00 - ca. 12.00 Uhr)

SA-CCR

- Was sind Exposuremaße wie SA-CCR?
- Wofür wird SA-CCR verwendet?

Exposure-Ansätze in CRR I

- OEM
- Standard-Methode
- Marktbewertungsmethode
- Interne Modelle

Exposure-Ansätze in CRR II

- Modifizierte OEM
- Vereinfachte SA-CCR
- Reguläre SA-CCR
- Interne Modelle

09.30 Pause

Das SACCR-Modell

- Was ist die Idee hinter dem SACCR-Modell und seinen Bestandteilen?
- Anerkennung und Behandlung von Sicherheiten
- Illustrative EaD-Berechnung nach SACCR für Einzelpositionen

Ca. 12.00 Ende des 1. Seminartages

TEIL 2 (08.00 - ca. 12.00 Uhr)

Umsetzungsempfehlungen und Beispiele aus der Praxis

- Komponenten und konzeptionelle Vergleiche: modifizierte OEM, vereinfachte SA-CCR und reguläre SA-CCR
- Mappen von Derivaten auf die Netting Sets
- Berechnung von modifizierter OEM, vereinfachter und regulärer SA-CCR für ein besichertes und ein unbesichertes Beispielportfolio (in einem Beispiel-XLS)

- SA-CCR-Berechnungen am Beispiel eines Portfolios mit 30 Derivaten
- Besonderheiten der SA-CCR-Berechnung für LevRatio, Großkredite und Millionenkredite

09.30 Pause

Mapping von Transaktionen zu Risikoklassen und Hedgingsets

gemäß RTS 2019-02

Ca. 12.00 Ende des Seminars

IHR REFERENT



Dario Ruggiero ist Senior Manager der Aspect Advisory Group und Chartered Financial Analyst (CFA). Zuvor war er viele Jahre als Senior Consultant für einen großen Meldewesenanbieter tätig. Sein Hauptaugenmerk lag dabei auf der Beratung und technischen Implementierung aufsichtsrechtlicher Neuerungen bei Retailbanken, Privatbanken und deutschen Landesbanken.

Je nach Verfügbarkeit von Herrn Ruggiero kann es sein, dass Prof. Dr. Schmalz ihn teilweise oder komplett vertritt (www.exbase.de/saccr).

HINWEISE ZUR VERANSTALTUNG

Als Unterlagen erhalten Sie die Präsentation als Ringbuch und PDF. Um nahe an den Originalpublikationen zu bleiben, sind diese in englischer Sprache verfasst. Die Schulung wird auf Deutsch durchgeführt.

FEEDBACK

„Sehr guter Einblick in die nicht-trivialen Berechnungsschritte, die der SA-CCR vorschreibt.“ (H. Fullriede, Revisor Risk & Governance, Nord/LB)

„Technisch hat alles wunderbar geklappt und der Tag hat uns fachlich wirklich sehr weiter gebracht.“ (K. B., Business Analyst, iBS AG)

„Sehr empfehlenswert, um ein detailliertes Bild der SA-CCR zu bekommen.“ (P. B., Risikococontrolling, NRW.BANK)

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

- 10. und 11. Juli 2024, je 08:00 - ca. 12:00 Uhr (Webinar)
- 26. Nov. 2024, 09:00 - ca. 17:00 Uhr (Frankfurt am Main / Webinar)

Die Teilnahmegebühr beträgt pro Person und Termin **EUR 950,00** zzgl. MwSt.

Bei gleichzeitiger Anmeldung von mehreren Personen eines Unternehmens für denselben Termin erhält die zweite und jede weitere Person eine **Ermäßigung in Höhe von 10%** des Seminarpreises.

1. PERSON

Anrede, Titel

Name, Vorname

Position, Abteilung

E-Mail

Firma

Straße, Nr.

Postfach

PLZ, Ort

Land

2. PERSON

Anrede, Titel

Name, Vorname

Position, Abteilung

E-Mail

10% Rabatt

RECHNUNGSDetails

Bestellreferenz

MwSt.-Nr.

Firma

Abteilung

Straße, Nr.

PLZ, Ort

Datum, Unterschrift

ANMELDUNG

Web www.exbase.de/saccr
Telefon +49 (0)9194 7952057
E-Mail info@exbase.de
Post Exbase
Hauptstr. 1
91364 Unterleinleiter
Deutschland

VERANSTALTUNGSORTE

Unsere Veranstaltungen finden meist in zentraler Lage in einem 4-Sterne-Hotel statt. Die Seminarzeiten variieren je nach Termin. Auch an unseren Präsenzterminen können Sie per Webinar teilnehmen.

TEILNAHMEBEDINGUNGEN

Geltungsbereich

Die Allgemeinen Geschäftsbedingungen regeln das Vertragsverhältnis zwischen Teilnehmer*innen einer Veranstaltung und Exbase als Veranstalter. Teilnehmer*innen erkennen mit ihrer Anmeldung diese Teilnahmebedingungen an.

Teilnahmegebühr

Die Teilnahmegebühr beinhaltet die Teilnahme für eine Person. Sie versteht sich inklusive schriftlicher Unterlagen und im Falle einer Teilnahme vor Ort auch inkl. Mittagessen und Tagungsgetränken zzgl. MwSt. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Diese ist in jedem Fall vor Eintritt in die Veranstaltung fällig.

Anmeldung

Die Anmeldung kann über das Anmeldeformular online, per E-Mail, per Post oder mündlich per Telefon erfolgen. Jede Anmeldung erlangt erst durch die schriftliche Bestätigung seitens des Veranstalters Gültigkeit und ist verbindlich.

Urheberrecht

Alle im Rahmen der Veranstaltungen ausgegebenen Unterlagen sowie anderweitig erworbene Artikel sind urheberrechtlich geschützt. Vervielfältigungen und anderweitige Nutzung sind schriftlich durch den Veranstalter zu genehmigen.

Rücktritt

Sollte die Teilnehmerin / der Teilnehmer an der Teilnahme verhindert sein, so ist sie / er berechtigt, ohne zusätzliche Kosten eine Ersatzteilnehmerin oder einen Ersatzteilnehmer zu benennen. Darüber hinaus ist eine kostenlose Stornierung bis dreißig Tage vor Beginn der Veranstaltung möglich. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Bei späterem Rücktritt oder Nichterscheinen wird die gesamte Teilnahmegebühr fällig. In diesem Fall können Sie Ihre Teilnahme zu einem Folgetermin kostenfrei nachholen, sofern dieser stattfindet.

Programmänderungen und Absagen

Der Veranstalter behält sich vor, wenn notwendig Änderungen am Inhalt der Veranstaltung vorzunehmen und Referent*innen auszutauschen, sofern der Gesamtcharakter der Veranstaltung gewahrt bleibt. Wird eine Veranstaltung aus wirtschaftlichen Gründen oder aufgrund von höherer Gewalt (kriegerische Auseinandersetzungen, Unruhen, terroristische Bedrohungen, Naturkatastrophen, politische Beschränkungen, erhebliche Beeinflussung des Transportwesens usw.) abgesagt, so ist Exbase verpflichtet, alle Teilnehmer*innen umgehend zu benachrichtigen. In diesem Fall besteht Anspruch auf Rückerstattung der Veranstaltungsgebühr. Weitergehende Kosten wie bspw. Stornierungsgebühren von Teilnehmer*innen werden von Exbase nicht erstattet.

Haftung

Alle Veranstaltungen werden sorgfältig recherchiert, aufbereitet und durchgeführt. Sollte es dennoch zu Schadensfällen kommen, so übernimmt der Veranstalter keine Haftung für die Vollständigkeit und inhaltliche Richtigkeit in Bezug auf die Vortragsinhalte und die ausgegebenen Unterlagen.

Datenschutz

Überlassene persönliche Daten behandelt der Veranstalter in Übereinstimmung mit den geltenden datenschutzrechtlichen Bestimmungen. Sie werden zum Zwecke der Leistungserbringung elektronisch gespeichert. Einblick und Löschung der gespeicherten Daten kann jederzeit gefordert werden. Anfragen bitte per E-Mail an info@exbase.de.

Schlussbestimmungen

Der Vertrag unterliegt dem deutschen Recht.