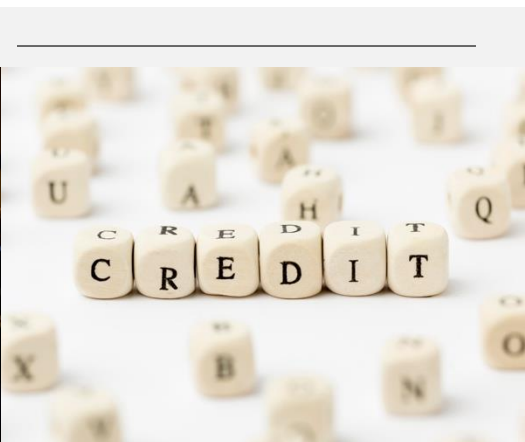




Haben Sie eine Frage? Senden Sie
uns eine E-Mail an:
aaa.aspectadvisory.eu

<https://www.aspectadvisory.eu/academy/>

Säule 1: Standardansatz für das Kreditrisiko (KSA)

ZUSAMMENFASSUNG:

80 % der gesamten risikogewichteten Aktiva sind in der Regel Kreditrisiko-RWA. Der Standardansatz für das Kreditrisiko ist daher der wichtigste und einflussreichste Baustein des RWA-Rahmenwerks der Säule 1. Mit der CRR III wird der Standardansatz für das Kreditrisiko auch einen wichtigen Beitrag zur Output-Untergrenze leisten. Ein gründliches Verständnis der Zielsetzung, Struktur und Hauptelemente des Standardansatzes für das Kreditrisiko ist daher unerlässlich.

ÜBERSICHT ÜBER DIE TAGESORDNUNG:

1 Day Seminar – please refer following slide

WER SOLLTE TEILNEHMEN:

Wir glauben, dass dieses Seminar für Teilnehmer aus folgenden Bereichen am nützlichsten ist:

- Regulatorische Berichterstattung/Angelegenheiten
- Risiko- und Regulierungsberater
- Risikokontrolle
- Interne Revision
- Kreditrisikokontrolle
- Treasury
- Aufsichtsbehörden

SEMINARFORMAT:

- Dieses Seminar wird auf Englisch abgehalten.
- Diese Sitzung wird über Microsoft Teams abgehalten. Nach Abschluss Ihrer Anmeldung erhalten Sie einen Link zum Meeting.

KURSUNTERLAGEN:

- Die Sitzungen werden aufgezeichnet und können auf Anfrage am Ende des Seminars angefordert werden.
- Die Präsentationsfolien der Trainer können auf Anfrage am Ende des Seminars angefordert werden.

ZERTIFIKAT:

- Die Teilnehmer erhalten nach Abschluss des Seminars Zertifikate per E-Mail.

Säule 1: Standardansatz für das Kreditrisiko (KSA)

BEISPIELEINTEILUNG

TAG 1

	Säule 1: Standardansatz für das Kreditrisiko (KSA)
09:00	1. Mechanik der CRSA: Positionsklassen, Risikopositionswerte, Risikogewichte, Kreditrisikovorsorge
10:30	2. Kreditumrechnungsfaktoren
	Kaffeepause am Morgen
10:45	3. CRSA-Risikogewichte
12:15	▪ Staatsanleihen ▪ Banken ▪ Unternehmen ▪ Pfandbriefe ▪ Einzelhandel ▪ Hypotheken ▪ Spezialkredite ▪ Sonstige Vermögenswerte
	Mittagessen
13:30	4. Banken ohne Rating
15:00	5. Derivate (im Vergleich zu Darlehen)
	Kaffeepause am Nachmittag
15:15	6. Kreditderivate (im Vergleich zu Darlehen)
17:00	7. CRSA-Berechnungen für eine kleine Musterbank 8. CVA-Standardansatz (einschließlich Abweichung vom internen CVA) 9. Schlussfolgerungen