



Großes Belichtungsprogramm

ZUSAMMENFASSUNG:

Das Large Exposure Regime (nachfolgend abgekürzt als „LER“) dient als Sicherungsmaßnahme, um den maximalen Verlust zu ermitteln, den die Bank durch den Ausfall eines einzelnen Kontrahenten erleiden kann. In letzter Zeit hat das LER durch die obligatorische Substitution von Sicherheitengebern sowie durch indirekte Risiken aus Derivaten wichtige Änderungen erfahren. Nach dem Seminar werden die Teilnehmer mit den Bausteinen des LER und den verschiedenen Möglichkeiten zur Messung der damit verbundenen Risiken – einschließlich indirekter Risiken aus Derivaten – vertraut sein.

ÜBERSICHT ÜBER DIE TAGESORDNUNG:

1-tägiges Seminar – siehe folgende Folie

WER SOLLTE TEILNEHMEN:

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

- Kreditrisikokontrolle
- Rechnungswesen
- Aufsichtsbehörden
- Aufsichtsrechtliche Berichterstattung/Angelegenheiten
- Interne Revision

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.

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

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

TAG 1

Großes Belichtungsprogramm

09:00

1. Ziele und Annahmen von LER
2. Wie berechnet man die Gesamt-LER-Exposition eines Kunden?

10:30

3. Großrisiken und Großrisikogrenzen: Berichterstattung, Benachrichtigung und andere Konsequenzen

Kaffeepause am Morgen

10:45

4. Belichtungswerte für LEX:

12:15

- Ausnahmen
- Standarddarlehen/Sicherheit
- Gegenparteausfallrisiko von Derivaten
- Indirekte Engagements aus Derivaten (Einzeladressen, Index – mit und ohne Look-Through)

Mittagessen

13:30

5. Belichtungswerte für LEX-Grenzwert

15:00

- Ausnahmen
- Berechnung der Grenzwerte
- Vergleich der Positionen unter LEX mit den Expositionen unter dem LEX-Grenzwert

Kaffeepause am Nachmittag

15:15

6. Fallstudie:

17:00

Behandlung von Back-to-Back-Hedged-Indexderivaten im Rahmen des indirekten Clearings und mit bzw. ohne Look-Through.