



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.

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

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

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

- Staatsanleihen
- Banken
- Unternehmen
- Pfandbriefe
- Einzelhandel
- Hypotheken
- Spezialkredite
- Sonstige Vermögenswerte

12:15

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)

7. CRSA-Berechnungen für eine kleine Musterbank

17:00

8. CVA-Standardansatz (einschließlich Abweichung vom internen CVA)

9. Schlussfolgerungen