



## SA-CCR-Seminar

### ZUSAMMENFASSUNG:

Das Kontrahentenrisiko von Derivaten ist ein integraler Bestandteil des RWA-Rahmens. Das Kontrahentenrisikoprofil von Derivaten ist jedoch komplex: Es ändert sich täglich, da sich auch der Marktwert täglich ändert. Sicherheiten sollten berücksichtigt werden und auch potenzielle Preisänderungen nach dem Ausfall bis zur endgültigen Abwicklung. Schließlich ist es wichtig, die Dinge einfach zu halten, da es sich um einen standardisierten/vereinfachten Ansatz handelt. Das Seminar wird die allgemeine Philosophie des SACCR-Ansatzes, seine Hauptbausteine sowie seine Daten- und Umsetzungsherausforderungen vorstellen.

### ÜBERSICHT ÜBER DIE TAGESORDNUNG:

**1-tägiges Seminar** – bitte beachten Sie die folgenden Folien

### WER SOLLTE TEILNEHMEN:

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

- Aufsichtsbehörden
- Aufsichtsrechtliche Berichterstattung/Angelegenheiten
- Risikomanagement
- Risikokontrolle
- Interne Revision
- Modellvalidierung

### 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](mailto:aaa.aspectadvisory.eu)*

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

### TAG 1

#### SA-CCR Seminar

09:00

- 1 Kontextualisierung:** Verwendung von Risikomessgrößen in der CRR-RWA/Verschuldungsquote/Großkreditquote
- 2.** Hauptbausteine/Trestruktur von SACCR pro Netting-Satz: Kontrahent/Netting-Satz/Risikokategorien/Hedging-Satz/Buckets/Margenvereinbarung
- 3.** Zuordnung von Derivaten zu Risikokategorien (einschließlich Derivate mit mehreren Risikotreibern)

10:30

- 4.** Beispiel mit den wichtigsten Merkmalen
- 5. 1 Handelsbeispiele:**
  - Angepasster Nominalwert
  - Mit und ohne Marge
  - AddOn trotz negativer Marktwerte
  - AddOn-Aggregation

#### Kaffeepause am Morgen

10:45

- 6. 3 Handelsbeispiele in jeder Risikokategorie**
  - AddOn-Berechnung und Aggregation für IR/CS/EQ/FX/Commodity – Derivate
  - Lineare vs. nicht-lineare Derivate

12:15

## 1 DAY

Mittagspause

### 7. Details

- Risikokategorien vs. Hedging-Sets
- Basisswaps und Volatilitäts-Underlyings
- Nominalwertanpassungen
- Festlegung von Start- und Enddatum
- Reguläres vs. standardisiertes SACCR-Modell

13:30

15:00

Kaffeepause am Nachmittag

### 8. Verschiedenes

- SACCR für Leverage Ratio
- Gesamtbild
- Beispielmodell mit einem Netting-Set von 30 Geschäften
- SACCR-Schnittstelle und Datenbeschaffung
- Zusammenfassung

15:15

17:00

Ende der Sitzung