

SA-CCR im überarbeiteten KSA

Regulatorische Anforderungen und Lösungsansätze für die Implementierung

www.exbase.de

Im Seminar werden die neuen Anforderungen und deren Auswirkungen auf Ihr Institut besprochen. Zudem werden insbesondere für die Umsetzung relevante Fragen geklärt.

SEMINARVORSCHLAG

9.00

Einordnung in den regulatorischen Kontext

- Welche Geschäfte Ihres Instituts fallen unter den Standardansatz?
- In welchen Kennzahlen (RWA, LevR, NSFR, ...) wird der SA angewendet?
- Wie sieht der europäische Zeitplan zur Umsetzung aus?

Methodik und Auswirkungen mit Blick auf die Gesamtbanksteuerung

- Methodische Vorgensweise in Abgrenzung zu OEM, CEM und SM
- Quantitative Auswirkungen
- Datenanforderungen zur Berechnung
- Datensynergien mit anderen Regulierungsinitiativen (SIMM, FRTB, CVA)

10.30

Kaffeepause

10.45

Herausforderungen bei der Implementierung in Ihrem Institut

- Datenverfügbarkeit
- Regulatorische Hedging Sets
- Zentrale Gegenparteien
- Klärung konkreter Fragen

12.15 Ende des Seminars

IHR REFERENT



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Professor für Finance an der Aarhus University. In Lehre und Forschung befasst er sich intensiv mit der Steuerung und Regulierung von Banken. Während seiner Tätigkeit als Consultant bei True North Partners betreute er viele europäische Banken im Risikomanagement und in der Umsetzung regulatorischer Anforderungen. Als gefragter Referent spricht er regelmäßig auf Konferenzen und gibt Seminare zu aufsichtsrechtlichen Themen. Betreffend des SA-CCR hat Herr Schmaltz Lobbyarbeit betrieben und eine Auswirkungsanalyse für eine Bank durchgeführt.

Für die Präsentation im Rahmen unserer Seminarveranstaltungen 2016 erhielt Prof. Dr. Schmaltz im Schnitt **8,92** von 10 möglichen Punkten. Nachfolgend ein paar Teilnehmerstimmen:

"Herr Dr. Schmaltz versteht es, das Seminar auf die Bedürfnisse der Gruppe anzupassen."

F. Mumme, Verhinderungsvertreter des Leiters Revision Financial Markets, Nord/LB

„Wer eine Systematisierung der Themen zum Liquiditätsrisikomanagement unter CRR sowie eine integrierte Darstellung der Einzelthemen wünscht, erhält hier genau den richtigen Überblick und geht mit den richtigen Fragen wieder nach Hause. Diese Art von Anstößen kann nur jemand geben, der nicht nur in Lehre, sondern auch in Aufsicht und Industrie zu Hause ist. Ich bin sehr zufrieden.“

D. Rademacher, Oldenburgische Landesbank