

Risikomanagement mit SimCorp Dimension - Anlieferung an das Meldewesen (S689)

Seminarnummer	22.11.T689.05
Termin	Dienstag, den 22.11.2022
- Zeit	08:30 Uhr bis 16:30 Uhr
- Ort	Raum 4, Akademie der Sparkassen-Finanzgruppe Saar
- Referent/in	Mitarbeiter/-in der Firma Preyer GmbH
Zielgruppen	Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Handel, Abwicklung, Controlling und Meldewesen, die regelmäßig Eingaben und/oder Abfragen in SimCorp Dimension vornehmen.
Zielsetzung	<ul style="list-style-type: none">• Die Teilnehmer/-innen lernen wichtigste Felder und Funktionen in der Anwendung SimCorp Dimension (SCD) zur Erfüllung der nationalen aufsichtsrechtlichen Meldepflicht kennen• Ihnen werden die Kennzeichnungsmöglichkeiten in SCD für die Meldeerfordernisse nach Basel III sowie für die Fondsdurchschau nach der Transparenzmethode vermittelt• Anhand von Fallbeispielen können Sie die notwendige Verschlüsselung von Depot- und Gattungseinstellungen vornehmen• Die Erfassungsmöglichkeiten zur Erfüllung des europäischen Aufsichtsrechts (Transaktionsregister/ EMIR) sind nicht Bestandteil dieser Schulung
Inhalte	<ul style="list-style-type: none">• Felder und Funktionen in SCD, die Einfluss auf die Anlieferung an das Meldewesen haben<ul style="list-style-type: none">◦ Relevante Felder und Einstellungen auf den Gattungen, Depots, Partnern und in den GeschäftsmaskenInstrumentbezogene Einstellungen für das Meldewesen◦ Auswertungen mit den relevanten Stichtags- und Periodenberechnungen und dem Echtbestand• Die Erfassungsfelder in SCD<ul style="list-style-type: none">◦ Für Basel III (COREP)◦ Für die Meldung von Abwicklungs- und Vorleistungsrisiken (inkl. Prozessbeschreibung)• Die Durchschaumöglichkeiten nach der Transparenzmethode<ul style="list-style-type: none">◦ Notwendige Verschlüsselung von Depot- und Gattungseinstellungen anhand von Fallbeispielen◦ Diverse Stufen der Durchschau◦ Zerlegung der Fonds im Fonds◦ Die Positionspreispflege (Anteil am Fondsvermögen)◦ Möglichkeit der Anrechnung eines Fonds auf den "Unbekannten Schuldner" aller Konstrukte◦ Auswertungen zur Abstimmung mit dem Meldewesen• LCR• FINREP<ul style="list-style-type: none">◦ Felder für das Meldewesen• ALMM<ul style="list-style-type: none">◦ Abstimmung der Cashflows
Hinweis	Max. 2 Teilnehmer/-innen pro Sparkasse

Zuständig

- Inhalt/Organisation

Backes, Timo
timo.backes@svsaar.de

Meldeschluss

Freitag, den 11.11.2022