

PwC Plus Article

By DK - Die Deutsche Kreditwirtschaft | 15.06.2021

Stellungnahme zu Brutto-Jump-to-Default-Beträgen bei Schuldtiteln und Eigenkapitalinstrumenten

Die DK bittet darum, die Behandlung von Indexinstrumenten, Instrumenten mit mehreren Basiswerten und OGAs für die Berechnung des Ausfallrisikos zu spezifizieren.

Keywords

Bankenaufsicht (Deutschland), Bankenaufsicht (Europäische und Internationale Organisationen), Capital Requirements Regulation (CRR), Eigenmittel / Eigenkapital, Marktpreisrisikoregelungen, Risk Management Banking, Securitisation / Verbriefung

FS-sector(s)

Banking & Capital Markets

Topics

Risk & Regulation

Issuing Body

DK - Die Deutsche Kreditwirtschaft