

Liquiditätsrisikomanagement

Liquiditätsrisiken aufsichtskonform messen und steuern

DIE THEMEN

- NSFR, CRR II, AMM, SREP, ILAAP: Liquiditätsregulierung
- Änderung der delegierten Verordnung zur LCR, Eventualverpflichtungen, ITS, ILAAP-Meldewesen
- Auslegung, Implementierung und Anwendungsbeispiele
- Abbildung verschiedener Produkttypen in LAB und FTP
- Liquiditätsreserve: Höhe und Fristigkeit
- Direkte und indirekte Liquiditätskosten, Transferpricing

Neue
Liquiditätsanforderungen
erfolgreich umsetzen

IHRE REFERENTEN



Dr. Engelbert Plassmann

Asset Liability Management,
Group Treasury,
Commerzbank AG,
Frankfurt am Main



Jörg Schäfer

Grundsatzfragen Internationale
Eigenkapital- und Liquiditätsregelungen,
Deutsche Bundesbank,
Frankfurt am Main

Ihr Programm im Überblick

Aktuelle Entwicklungen in der Liquiditätsregulierung

- Regulatorische Vorgaben: LCR, NSFR, AMM, SREP
- Laufende Projekte des Baseler Ausschusses
- Einführung der NSFR in der EU (CRR II)
- Änderung der delegierten Verordnung zur LCR
- BaFin-Rundschreiben zu Artikel 23 CRR & LCR-Offenlegung
- ILAAP-Meldewesen
- Anwendungs- und Auslegungsfragen

Liquiditätsrisikosteuerung, Umsetzung und Erfahrungen

- Messung des Liquiditätsrisikos
- Abbildung diverser Produkttypen in LAB und FTP
- Höhe und Fristigkeit der Liquiditätsreserve
- Direkte und indirekte Liquiditätskosten
- Konzept des Liquiditäts-Transferpricings
- Die Liquiditätsspreadkurve als Steuerungsinstrument
- Integration regulatorischer Nebenbedingungen

Kombinationsmöglichkeiten

z.B. mit "Zinsrisikomanagement" am 25.11.19 und/oder "Neuausrichtung der Risikotragfähigkeit" am 26.11.19:
2 Seminartage: 1.580,- €, 3 Seminartage: 1.990,- €

Ziel des Seminars

Mit der Capital Requirements Regulation (CRR) hat eine Regulierungswelle mit besonderem Fokus auf das Thema Liquidität begonnen. Insbesondere müssen die Institute die Kennziffern LCR und NSFR sowie den Überwachungs-Parameter AMM implementieren und melden und die LCR offenlegen. Die Überarbeitung der Liquiditätsanforderungen stellt die Institute vor neue Herausforderungen, die das Liquiditätsmanagement neben Vorgaben zur Ertrags- und Risiko-Optimierung berücksichtigen muss.

In diesem Seminar erfahren Sie von unseren Experten aus Aufsicht und Treasury-Praxis, welche aktuellen und neuen regulatorischen Anforderungen und Nebenbedingungen Sie beachten müssen und wie diese umzusetzen, zu interpretieren und zu melden sind. Dabei lernen Sie anhand von praktischen Anwendungsbeispielen, wie Sie Liquiditätsrisiken und -kosten aufsichtskonform messen, steuern und optimieren.

Teilnehmerkreis

Das Seminar richtet sich an alle, die mit der aufsichtskonformen Umsetzung der Liquiditätsregulierung sowie einer professionellen Messung, Steuerung, Optimierung und Meldung von Liquiditätsrisiken konfrontiert werden.

MEHR INFORMATIONEN

www.forum-institut.de
Webcode 1911365
service@forum-institut.de
Tel. +49 6221 500-500
Fax +49 6221 500-555

Gebühr:

€ 990,00 (+ gesetzl. MwSt.)

Veranstaltungsort:

Mittwoch, 27. November 2019 in Frankfurt,
9:00 - 17:00 Uhr
Le Méridien Parkhotel



AGB

Es gelten unsere Allgemeinen Geschäftsbedingungen (Stand: 01.01.2016), die wir auf Wunsch jederzeit übersenden und die im Internet unter www.forum-institut.de/agb eingesehen werden können.

IHR ANSPRECHPARTNER



Carmen Fürst-Grüner

Konferenzmanagerin Financial Services
Tel. +49 6221 500-860
c.fuerst-gruener@forum-institut.de