

Ganzheitliche Steuerung von Liquiditätsrisiken im Kontext von MaRisk und ILAAP

Seminarnummer	18.08.3610.01
Termin	Mittwoch, den 08.08.2018 bis Donnerstag, den 09.08.2018
- Zeit	08:30 Uhr bis 16:30 Uhr
- Ort	Raum 2, Akademie der Sparkassen-Finanzgruppe Saar
- Referent/in	Christoph Bleses und Dr. Michael Lesko, ICnova AG
Zielgruppen	Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Treasury, Risikocontrolling und Revision, die mit der Umsetzung der aktuellen Anforderungen befasst sind sowie Vorstandsmitglieder mit Interesse an Detailwissen.
Zielsetzung	Das Seminar vermittelt einen Überblick über die Anforderungen, zeigt Lösungsansätze auf und vermittelt die methodischen Grundlagen in den verschiedenen Teilfragestellungen mit hohem Praxisbezug (u. a. durch zahlreiche Fallbeispiele).
Inhalte	<ul style="list-style-type: none">• Einführung und Überblick• Aufsichtsrechtliche Aspekte des Liquiditätsrisikos<ul style="list-style-type: none">◦ ILAAP: Anforderungen an ein ganzheitliches Liquiditätsrisikomanagement◦ Anforderungen der aktuellen MaRisk◦ Überblick sonstige Kennzahlen• Abbildung des Zahlungsfähigkeitsrisikos (Survival Period Ansatz)<ul style="list-style-type: none">◦ Zielsetzung und methodische Grundlagen◦ Aufstellen der Liquiditätsbedarfsübersicht: Wie müssen die Positionen unter dem Aspekt der Zahlungsfähigkeit abgebildet werden?◦ Was sind die relevanten Kennzahlen und wie können diese gesteuert werden?• Abbildung der dispositiven Liquidität<ul style="list-style-type: none">◦ Zielsetzung, methodische Grundlagen und Datenbasis der Modellierung der dispositiven Liquidität◦ Wie erfolgt die Ex-Post-Ermittlung eines Puffers?◦ Wie kann eine Ex-Ante-Prognose zur Unterstützung der Gelddisposition aufgestellt werden?• Kalkulation und Verrechnungspreissysteme<ul style="list-style-type: none">◦ Die Rolle des Liquiditätstreasury und Verrechnungsbeziehungen (Kundengeschäft, Handelsbuch, Strategische Vermögensanlage)◦ Die Wahl der richtigen Bewertungskurven◦ Kalkulation von Liquiditätskosten, -nutzen und -risiken im Einklang mit der Marktzinsmethode: Steuerung im Engpass?◦ Integration der Liquidität in das Deckungsbeitragsschema◦ Kalkulation des Festzinsgeschäfts◦ Kalkulation des Variablen Geschäfts: Mischungsverhältnisse für Liquidität?• Liquiditäts- und Refinanzierungsrisiken bei wertorientierter Betrachtung<ul style="list-style-type: none">◦ Relevante Zinskurven und Aufspaltung des Risikofaktors◦ Ermittlung des Liquiditätsrisikocashflows◦ Liquiditätsmischungsverhältnisse: Besonderheiten bei der Abbildung des variablen Geschäfts◦ Liquiditätsprämienbarwert und Refinanzierungskostenbarwert◦ Risikomodell, Performance und Risiko◦ Steuerung der Liquiditätsfristentransformation: Impulse, Benchmarks und

- Effizienz
 - Integration in die wertorientierte Gesamtbanksteuerung
- Liquiditäts- und Refinanzierungsrisiken bei periodischer Betrachtung
 - Aufspaltung des Zinsüberschusses und Ermittlung von Liquiditätsbeiträgen
 - Abbildung des Bestandsgeschäfts
 - Abbildung des geplanten Neugeschäfts
 - Szenarioanalyse in Bezug auf die wesentlichen Risikofaktoren
 - Interpretation der Ergebniswerte
 - Integration in periodische Risikotragfähigkeits- konzeptionen
- Fallbeispiele

Zuständig

- Organisation

Backes, Timo
timo.backes@svsaar.de

- Inhalt

Stephan, Lisa-Marie
lisa-marie.stephan@svsaar.de

Meldeschluss

Freitag, den 06.07.2018