

Betriebswirtschaftliche Grundlagen zur Liquiditätsrisikosteuerung

Seminarnummer	14.07.2020.01
Termin	Donnerstag, den 10.07.2014 bis Freitag, den 11.07.2014
- Zeit	8.30 Uhr bis 16.30 Uhr
- Ort	Raum 3, Akademie der Sparkassen-Finanzgruppe Saar
- Referent/in	Klaus Stechmeyer-Emden, msgGillardon AG
Zielgruppen	Mitarbeiter aus Treasury, Zentraldisposition, Aktiv- / Passiv-Management, Controlling und Revision. Das Seminar richtet sich sowohl an Einsteiger im Themenfeld Liquiditätsrisikosteuerung als auch an Professionals.
Zielsetzung	<p>Die Finanzmarktkrise hat den Faktor „Liquidität“ nachhaltig in den Mittelpunkt einer modernen Banksteuerung gerückt. Im Rahmen dieses Seminars erhalten die Teilnehmer einen Überblick über die aktuellen aufsichtsrechtlichen Entwicklungen und lernen die Verfahren einer ganzheitlichen Messung und Steuerung von Liquiditätsrisiken mit dem Fokus auf Zahlungsfähigkeit und Kostenrisiko kennen.</p> <p>Neben der Vermittlung der Basismethoden und Modelle zur Liquiditätsrisikosteuerung werden auch die Möglichkeiten zur Optimierung der Liquiditätsposition erörtert. Dies ermöglicht den Teilnehmern eine optimale Liquiditätsstrategie für ihre Sparkasse festlegen zu können.</p> <p>Die Teilnehmer erfahren, wie sie die Liquiditätsposition der Sparkasse hinsichtlich der Kennzahlen LCR und NSFR optimieren. Weiterhin wird dargestellt, wie basierend auf einem Verrechnungs- oder Liquiditätstransferpreissystem Wettbewerbsvorteile im Pricing unter Berücksichtigung von Liquiditätskosten erzielt werden können und mit Hilfe von verfeinerten Verfahren die Liquiditätskostenposition noch detaillierter abgebildet werden kann.</p>
Inhalte	<ul style="list-style-type: none">• Motivation und Einführung zur Liquiditätsrisikosteuerung• Überblick über die aufsichtsrechtlichen Anforderungen• Liquiditäts-Cash-Flow und Liquiditätsablaufbilanzen• Aufbau der Gesamtbank auf Basis verschiedener Teilportfolien• Sichten auf das Liquiditätsrisiko<ul style="list-style-type: none">◦ Liquiditätsplanung◦ Zahlungsfähigkeit◦ Liquiditätskosten• Optimierung der Liquiditätsposition hinsichtlich LCR und NSFR• Zahlungsfähigkeitssicht<ul style="list-style-type: none">◦ Erstellung der Zahlungsfähigkeitssicht◦ Szenariobasierter Ansatz zur Steuerung der kurzfristigen Liquidität◦ Kennzahlen für das Reporting der Zahlungsfähigkeitssicht• Liquiditätskostensicht<ul style="list-style-type: none">◦ Liquiditätskosten in der Einzelkalkulation - Beispielrechnung◦ Diskussion verschiedener Refinanzierungsstrategien◦ Verfahren zur Bewertung der Liquiditätskostenposition◦ Liquiditätsvermögenssicht und Berechnung von Liquiditätsvermögenswerten◦ Statische und dynamische Risikomessung und Simulation des

Liquiditätskostenrisikos

- Liquiditätsverrechnungspreissystem und Liquiditätstransferpricing
 - Produktspezifischer vs. globaler Ansatz
 - Ermittlung der Liquiditätstransferpreisergebnisse
 - Abhängigkeiten zum refinanzierungsmixbasierten Pricing und zur wertorientierten Liquiditätskostensteuerung
- Ansätze für Liquiditätsbenchmarks und Wirkung von Maßnahmen
- Einbindung Liquiditätsrisiko in ein Risikocontrolling & Gesamtbanksteuerung
 - Risikotragfähigkeit
 - Limitierung und Maßnahmen
 - Liquiditätsrisiko im Kontext des Gesamtbankstresstests

Zuständig

- Organisation

Wissmann, Kerstin
kerstin.wissmann@svsaaar.de

Werthmüller, Myriam
myriam.werthmueller@svsaaar.de

- Inhalt

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

Meldeschluss

Freitag, den 06.06.2014