

Seminarangebot

Management von Liquiditätsrisiken unter veränderten strukturellen und regulatorischen Rahmenbedingungen

Seit der Veröffentlichung der Grundprinzipien für das Management von Liquiditätsrisiken durch den Baseler Ausschuss im Jahre 2000 haben sich die Bedingungen für und die Anforderungen an die Liquiditätssteuerung von Kreditinstituten grundlegend verändert. Ursächlich hierfür sind in erster Linie die Erfahrungen und Erkenntnisse der jüngsten Finanzkrise. Sie hat gezeigt, dass Liquiditätsrisiken unvermittelt schlagend werden und in extrem kurzer Zeit zum Zusammenbruch von Instituten führen können sowie in vielfältigen Wechselwirkungen zu anderen Risiken stehen. Verstärkt durch die verschiedenen nationalen und internationalen bankaufsichtlichen Regelungsinitiativen wird dem Liquiditätsrisikomanagement daher mittlerweile eine sehr viel größere Bedeutung zugemessen als noch vor wenigen Jahren. Entsprechend hoch ist der Bedarf an fundiertem Expertenwissen.

Seminarziele

Das Seminar macht die Teilnehmer mit dem derzeitigen Stand sowie dem aktuellen Rechtsrahmen für das Liquiditätsrisikomanagement und -controlling von Kreditinstituten vertraut und gibt ihnen einen umfassenden Überblick über die jüngsten internationalen bankaufsichtlichen Regelungsinitiativen. Im Zentrum stehen dabei insbesondere die Auswirkungen dieser Vorschläge auf das Liquiditätsrisikoregime der Institute.

Davon ausgehend wird den Teilnehmern auch ein umfassendes Verständnis der relevanten Methoden und Ansätze zur Erfassung, Messung, Steuerung und Überwachung von Liquiditätsrisiken vermittelt. Anhand von Fallstudien und angeleiteten Excel-Übungen arbeiten sie sich in die Funktionsweise ausgewählter Messmethoden ein und lernen, diese unter Beachtung regulatorischer sowie interner Anforderungen selbst anzuwenden. Daneben werden ebenfalls praxisbezogene Steuerungs- und Überwachungsprozesse vorgestellt und ihre Implementierung diskutiert.

Die Teilnehmer sollen so in die Lage versetzt werden, ein allen Anforderungen genügendes Liquiditätsrisikomanagement zu betreiben und ggf. dafür nötige Prozesse einzuführen. Nicht zuletzt schult das Seminar den Blick für das Zusammenspiel von Geschäfts- und Risikostrategie.

Programm

- Aufsichtsrechtliche Anforderungen an die Messung, Steuerung und Überwachung von Liquiditätsrisiken (Basel III, MaRisk, BCBS Standards, CEBS Guidelines und weitere internationale Regulierungsvorschläge)

- Unterscheidung zwischen den verschiedenen Aspekten der Liquidität und Definition der verschiedenen Ausprägungen des Liquiditätsrisikos
- Aufgaben und Ziele des Liquiditätsrisikomanagements und Abgrenzung zum Zinsrisikomanagement
- Kriterien bei der Bestimmung der angemessenen Liquiditätsbindung
- Übung: Bestimmung der Liquiditätsbindung für ausgewählte Finanzinstrumente im Kontext der Gesamtsituation eines Instituts
- Liquiditätsrisikoadäquates Funds Transfer Pricing
- Liquiditätskennzahlen und Liquiditätsablaufbilanzen
- Fallstudie: Aufbau einer Liquiditätsablaufbilanz
- Modellierung von Liquiditätsoptionsrechten (Kreditlinien, einmalige und Roll-over-Darlehen)
- Excel-Übung: Quantifizierung des Liquiditätsrisikos
- Bestimmung von Liquiditätspuffer und Ausgleichskapazität, Notfallpläne
- Liquiditätsrisiken im Stresstest
- Ansätze zur Festlegung der Liquiditätsrisikostrategie zur Bestimmung der Soll-Liquiditätssituation
- Übung: Bestimmung der Soll-Liquidität
- Excel-Übung: Liquiditätssimulation
- Liquiditätsrisiken im Kontext der Gesamtbanksteuerung

Methoden

Vortrag, Diskussion und Erfahrungsaustausch, Fallbeispiele, Excel-Übungen

Zielgruppen

Mitarbeiter von Banken, in den Bereichen Treasury, Risikomanagement und Risikocontrolling sowie Revision;
Wirtschaftsprüfer

Voraussetzungen

Studium oder äquivalente Ausbildung in einem fachnahen Bereich, berufliche Erfahrung

Dozenten

Dr. Peter Bartetzky
(TriSolutions GmbH)
Dr. Holger Thomae
(TriSolutions GmbH)

Veranstaltungsort

Frankfurt am Main

Dauer

01.03. - 02.03.2012 (2 Tage)

Max. Teilnehmerzahl

20 Personen

Teilnahmegebühr

1.450,00 EUR
(zzgl. gesetzlicher MwSt.)

Dieses Seminar ist auch als In-House Veranstaltung buchbar.

Kontakt:

EDA
vwd academy AG
Bettinastraße 59
60325 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 768075-20
Telefax: +49 69 768075-19
E-Mail: mail@ed-academy.com
Web: ed-academy.com