

Risikosteuerung

Ganzheitliche Steuerung von Liquiditätsrisiken im Kontext von MaRisk und ILAAP/ICAAP

07. - 08.05.2024
Online-Seminar

ICAAP und SREP Zahlungsfähigkeitsrisiko
Liquiditätskosten-
verrechnungspreissystem Liquiditätsspreadrisiko
ILAAP Refinanzierungsrisiken
Liquiditäts-Value-at-Risk (LVAR)

Seminarbeschreibung:

Aktuelle aufsichtsrechtliche Regelungen (MaRisk, AMM, ILAAP, ICAAP, SREP) fordern einen ganzheitlichen Blick auf die Steuerung von Liquiditätsrisiken. Dabei werden unterschiedlichste Teilfragestellungen (z. B. Zahlungsfähigkeitsrisiko, Refinanzierungskostenrisiko, Kalkulation) und unterschiedliche Sichtweisen (z. B. die ökonomische und die normative Sicht nach ILAAP und ökonomische und normative Sicht nach ICAAP) sowie verschiedene Auswirkungsdimensionen (z. B. Vermögen, Kapital) adressiert. Das Seminar vermittelt einen Überblick über die aufsichtsrechtlichen Anforderungen, zeigt fachliche Lösungsansätze auf und vermittelt die methodischen Grundlagen zu den verschiedenen Teilfragestellungen aus der Bankenpraxis.

Wer sollte teilnehmen?

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.

TERMIN:

07.-08. Mai 2024

ORT:

Online-Seminar

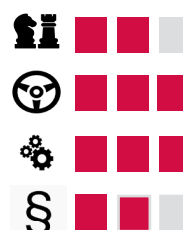
IHRE REFERENTEN:

Martin Feix,
Fabian Habiger

PREIS:

950,- EUR

SCHWERPUNKTE:



Risikosteuerung

Ganzheitliche Steuerung von Liquiditätsrisiken im Kontext von MaRisk und ILAAP/ICAAP

Inhalt des Seminars:

Überblick aufsichtsrechtliche Anforderungen zum Liquiditätsrisiko

- Anforderungen der aktuellen MaRisk
- ILAAP: Angemessenheit der Liquiditätsausstattung in der ökonomischen und normativen Perspektive
- ICAAP: Liquidität in der ökonomischen und in der normativen Sicht
- Liquidität im Kontext von ICAAP und SREP sowie Abgrenzungen
- Kurzüberblick: Weitere Anforderungen (u.a. AMM)

Abbildung des Zahlungsfähigkeitsrisikos

- Survival Period-Ansatz: Zielsetzung und methodische Grundlagen
- Modellierung
 - Liquiditätsdeckungspotenzial
 - Liquiditätsablaufbilanzen unter Szenarien
 - Liquiditätsbedarfsübersicht
- Relevante Kennzahlen und Steuerung
- Stresstesting
- Validierung von Parametrisierung und Ergebnissen
- Prozessuale Aspekte (z. B. Notfallplan)

Refinanzierungsplanung und Refinanzierungsquellenrisiken

- Ausgangspunkt Refinanzierungsstrategie
- Analyse Refinanzierungsstruktur
- Ableitung von Szenarien (Planfall und adverse Szenarien)

Kalkulation und Verrechnungspreissysteme

- Liquiditätstresury und interne Leistungsverrechnung (Kundengeschäft, Handelsbuch, Strategische Vermögensanlage)
- Auswahl der Bewertungskurve(n)
- Kalkulation von Liquiditätskosten, -nutzen und -risiken
- Integration der Liquidität in das Deckungsbeitragschema
- Kalkulation des Festzinsgeschäfts
- Kalkulation des variablen Geschäfts

Liquiditätsrisiken bei ökonomischer Betrachtung

- Relevante Zinskurven und Aufspaltung der Risikofaktoren
- Ermittlung des Liquiditätsrisikocashflows und Liquiditätsprämienbarwert
- Besonderheiten bei der Abbildung des variablen Geschäfts
- Risikomessung: Performance und Risiko (LVaR und Stresstesting)
- Steuerung der Liquiditätsfristentransformation: Impulse, Benchmarks und Effizienz
- ICAAP und Integration in die Gesamtbanksteuerung

Liquiditäts- und Refinanzierungsrisiken bei periodischer Betrachtung

- Aufspaltung des Zinsüberschusses und Ermittlung von Liquiditätsbeiträgen
- Abbildung des Bestandsgeschäfts
- Abbildung des geplanten Neugeschäfts
- Szenarioanalyse und Interpretation der Ergebnismwerte
- ICAAP Integration in periodische Risikotragfähigkeitskonzeptionen und Stresstesting

Anmeldung

**www.icnova.de/veranstaltungen,
e-mail: sekretariat@icnova.de oder
Fax:+49 (0) 721 / 464 72 33 – 9**

Seminar / Datum _____

Institut _____

Straße _____

PLZ / Ort _____

Name / Vorname _____

Abteilung / Funktion _____

Telefon / Fax _____

E-Mail _____

Anmeldeunterlagen und Rechnung senden Sie bitte an:

Name / Vorname _____

Abteilung _____

Telefon / Fax _____

E-Mail _____

Zimmerreservierung bei Präsenzveranstaltungen:

Wir haben im Veranstaltungshotel Hotel Rebstock in Würzburg und GenoHotel Karlsruhe ein Zimmerkontingent zu Sonderkonditionen reserviert. Nähere Informationen dazu finden Sie auf Seite 8/9 in unserem Seminarkatalog oder unter www.icnova.de.

- Bitte senden Sie mir auch zukünftig Ihren Seminarkatalog.
- Ich möchte Ihren Newsletter/Kundenzeitschrift zu aktuellen Themen und Veranstaltungen erhalten.

Mit meiner Unterschrift willige ich ein, dass die von mir angegebenen Daten von der ICnova AG zum Zweck der Auftragsbearbeitung und Zusendung der oben ausgewählten Informationen gespeichert und genutzt werden dürfen. Eine Weitergabe an Dritte erfolgt nicht. Mir ist bekannt, dass ich meine Einwilligung jederzeit bei der ICnova AG, An der RaumFabrik 33c, 76227 Karlsruhe widerrufen kann.

Datum _____

Unterschrift _____