

Ansätze zur Überprüfung/Beurteilung des Managements von Liquiditäts- und Refinanzierungs(kosten)-Risiken vor Hintergrund unsicherer Zinsentwicklungen!



Liquiditätsrisikomanagement nach ILAAP & MaRisk im Fokus der Aufsicht

Überprüfung der Liquiditätssteuerungs- & -überwachungsprozesse •
kritische Analyse von Risikomessverfahren & Liquiditätsstresstest •
Bewertung Refinanzierungskostenrisiko

10:00 - 13:00 Uhr

NN, Deutsche Bundesbank
(Anfrage läuft)

- Analyse der Auswirkungen stark steigender aber zuletzt sinkender Zinsen auf GuV, Bilanz und Risikotragfähigkeit – Erkenntnisse aus **LSI-Stresstest 2023/2024**, APM-Steuerung in Bezug auf **Zahlungsunfähigkeits-** und **Liquiditätsfristentransformationsrisiken** sowie **Liquiditätsspreads** bei Kredit-/Einlagengeschäften
- Rolle des „**Zinsschocks**“ als Grundlage zur Festlegung des **SREP-Kapitalzuschlags** für **Liquiditätsrisiken**
- Bemessung der **Liquiditätspuffer** in Abhängigkeit vom **Liquiditätsrisikoappetit**: Bewertung der Zielgrößen risikotragender **Kennzahlen** (LCR & NSFR) • Ermittlung des „**Überlebenshorizonts**“
- Anpassung der **Liquiditätsrisikolandkarte** auf Basis der **Risikoinventur** – **Wesentlichkeitsbeurteilung** und **Analyse** liquiditätsbezogener **Risikokonzentrationen** vor Hintergrund des Geschäftsmodells
- Würdigung der **zunehmenden Verzahnung** zwischen der **mehnjährigen Refinanzierungsplanung** (ILAAP) und der **Kapitalplanung** (ICAAP)
- Beurteilung des **Liquiditätsrisiko-Reporting**: zuverlässige **Risikodaten** und **Liquiditäts-Berichtswesen**? • plausible **Stresstest-Ergebnisse**? • adäquate **Notfallplan**-Änderung und Verprobung • inwieweit erfolgt eine **Integration** der **LCR** in den **ILAAP**?
- Bewertung **schwer messbarer** Liquiditätsrisiken durch **historische Simulation** und **Praktikerschätzungen** – **Stabilität** von **Zeitreihen** • Voraussetzungen für belastbare **Schätzungen** der **Liquiditätspufferhöhe**
- **(Stress-)Simulation** des **Refinanzierungsrisikos**: Sind die **Refinanzierungsquellen** und **Liquiditätsreserve** ausreichend **diversifiziert**? • existieren **Konzentrationen** bei Kunden, Interbanken, Depot A und Liquiditätsreserve? • inwieweit sind **ILAAP-(Stress-)Szenarien** mit ihren Risikoniveaus im ICAAP **deckungsgleich**?
- Jüngste **Umsetzungserfahrungen** mit Blick auf ein angemessenes Liquiditätsrisikomanagement

(dazwischen 15 min. Pause)

=> NN, Deutsche Bundesbank (Anfrage läuft)

Liquiditätsrisikomanagement nach ILAAP & MaRisk im Fokus der Aufsicht

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Liquiditätsrisikomanagement nach ILAAP & MaRisk im Fokus der Aufsicht
21.05.2025 (SE2505041) 499,00 €*

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	424,15 €
Treue PLUS 20	399,20 €
Treue PLUS 25	374,25 €

Wenn Sie eine individuelle Beratung zum Thema benötigen, unterstützen wir Sie gerne, klicken Sie hier: <https://www.fch-gruppe.de/consult>

Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen.
Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

Ich kann nicht am Seminar teilnehmen und bestelle deshalb die Seminarunterlagen als PDF zu den oben angekreuzten Seminaren
(150,00 € ** je Seminardokumentation)

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:
(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Die Auswirkungen unsicherer **Zinsentwicklungen**, drohender Bankpleiten und Firmeninsolvenzen **erhöht** die **Gefahr von Kapitalabflüssen**. Daher müssen die Institute ihre **Prozesse** und **Methoden** zur Steuerung und **Überwachung** von **Liquiditäts-** und **Refinanzierungsrisiken** nachschärfen. Dies erfordert u.a. eine Anpassung des **Liquiditätsrisikoappetits**, zunehmende **Verzahnung** der mehrjährigen **Refinanzierungs-** (ILAAP) mit der **Kapitalplanung** (ICAAP) und ein zeitnahes **Liquiditätsrisiko-Reporting**. Weiterhin ist eine **Neubewertung der Stress-Szenarien** zur Früherkennung drohender Zahlungsmittelabflüsse, Liquiditätsengpässe und **Refinanzierungslücken** erforderlich. Daneben ist das Zahlungsunfähigkeits- und Liquiditätsfristentransformationsrisiko im **Risikotragfähigkeits-Konzept** kritisch zu analysieren. Dies hat auch die **Bankenaufsicht** auf den **(Prüfungs-)Plan** gerufen.

21.05.2025 10:00 bis 13:00 Uhr

Tagungsort

ONLINE-Veranstaltung mit ZOOM, der Zugang erfolgt über "meinFCH", Sie erhalten rechtzeitig vor dem Seminar eine E-Mail, Zoom, Tel +49 6221-998980,

Der Zugang zum Seminar erfolgt über Ihren persönlichen Nutzerbereich in „MeinFCH“. Informationen zum Zugang und eine Anleitung erhalten Sie spätestens eine Woche vor dem Seminar. Ihre Teilnahmebestätigung und die Seminardokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei gemeinsamer Anmeldung in derselben Buchung einen Rabatt von **20%**.

Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung Ihre Anmeldebestätigung/Rechnung. Bitte überweisen Sie den Rechnungsbetrag innerhalb von 30 Tagen nach Zugang der Rechnung.

Eine Stornierung Ihrer Anmeldung ist nicht möglich. Eine kostenfreie Vertretung durch Ersatzteilnehmer beim gebuchten Termin dagegen schon. Der Name des Ersatzteilnehmers muss dem Veranstalter jedoch spätestens vor Seminarbeginn mitgeteilt werden. Wir weisen darauf hin, dass „Teilnahmen“ von anderen als den gebuchten Teilnehmern nicht gestattet sind und Schadensersatzansprüche des Veranstalters auslösen. Filmmitschnitt

Bei Absage durch den Veranstalter wird das volle Seminarentgelt erstattet. Darüber hinaus bestehen keine Ansprüche. Änderungen des Programms aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

Durch die Teilnahme am Seminar erhalten Sie 3 CPE-Punkte als Weiterbildungsnachweis für Ihre Zertifizierung.

* zzgl. 19 % MwSt. ** zzgl. 7 % MwSt.

Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die FCH AG und ihre Dienstleister (z. B. Lettershop) verwenden Ihre personenbezogenen Daten für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen ausgewählte Fach- und Produktinformationen per Post zukommen zu lassen. Sie können der Verwendung Ihrer Daten jederzeit durch eine Mitteilung per Post, E-Mail oder Telefon widersprechen.

Senden Sie mir bitte Fach- und Produktinformationen sowie die Banken-Times SPEZIAL für meinen Fachbereich kostenfrei an meine angegebene E-Mail Adresse (Abbestellung jederzeit möglich).

Senden Sie uns Ihre Bestellung per Mail an:
info@fch-gruppe.de

oder schriftlich an:
FCH AG
Im Bosseldorn 30, 69126 Heidelberg
Fax: +49 6221 99898-99

Weitere Informationen erhalten Sie unter:
+49 6221 99898-0
oder unter **www.FCH-Gruppe.de**

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen

Anmelden / Bestellen