



**WISSEN
MACHT
ERFOLG**

Liquiditätsrisikomanagement in der Bankenpraxis

Best-Practice: Bankspezifisches
Stresstesting

Seminar-ID: 10888

Kursinfo: **BEGINNER** **EXPERTE**

Veranstaltungsformat: Seminar

Das nehmen Sie mit

Die Mini-Finanzmarktkrise 2023 - Stichwort Silicon Valley Bank und Credit Suisse - und das Ende der lockeren Geldpolitik der EZB hat das Liquiditätsrisiko wieder stärker in den Fokus von Banken und Aufsicht gebracht. Frischen Sie Ihr Wissen auf und machen Sie sich mit gängigen Methoden und Instrumenten für eine erfolgreiche Liquiditätsrisikosteuerung vertraut. Aktuelle Praxisbeispiele aus einem EZB-beaufsichtigten österreichischen Bankenverbund und Erfahrungswerte aus aufsichtlichen On-Site-Prüfungen ergänzen das Seminar.

Für Ihren vollständigen Überblick über das Thema Liquiditätsrisiko empfehlen wir ergänzend das Seminar „Liquiditätsregulierung nach Basel III“ (20426), das sich schwerpunktmäßig mit aufsichtlichen Meldungen und Anforderungen beschäftigt.

Ihr Programm im Überblick

- Regulatorische Grundlagen und Identifikation Liquiditätsrisiko
 - Definition und Charakteristika von Liquiditätsrisiken
 - Regulatorischer Hintergrund
- Liquiditätsablaufbilanz und Cash Flow-Modellierung
 - Sichtweisen der Liquiditätsablaufbilanz
 - Integration von Neugeschäft
 - Modellierung von deterministischen und nicht-deterministischen Cash Flows
- Stresstestingframework für das Liquiditätsrisiko
 - Entwicklung bankspezifischer Liquiditätsrisikostresstests
 - Abgleich mit der LCR, Konzept der „Time-to-LCR“
 - Erfahrungswerte aus dem EZB-Liquiditätsstresstest 2019 und der „Mini-Finanzmarktkrise 2023“
- Liquiditätspuffer und Counterbalancing Capacity
 - Anforderungen an den Liquiditätspuffer
 - Konzept des Überlebenshorizonts
- Liquiditätsrisikonotfallplan
 - Frühwarnindikatoren und Maßnahmenplan
 - Prozessuale Implikationen
- Liquiditätskosten
- Liquiditätsrisiko-Governance und Liquiditätsrisikostrategie
- Implikationen auf die Gesamtbankrisikosteuerung
 - Liquiditätsrisikotragfähigkeitsanalyse
 - ILAAP und aufsichtlicher Li-SREP
 - Integrierte Liquiditätsrisikosteuerung

Komplementär dazu deckt das Seminar „Liquiditätsregulierung nach Basel III“ (20426) die Säule I--Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement ab.

Interessant für

- Bankmitarbeiter im Risikocontrolling bzw. im Bereich Treasury / ALM, Meldewesen & Innenrevision
- Mitarbeiter von Aufsichtsbehörden
- Geschäftsleiter und Aufsichtsräte
- Kreditinstitute und Wertpapierfirmen
- Rechtsanwaltskanzleien
- Bankprüfer

Referent*in



MMag. Markus Seifert PRM

Fachmann für Liquiditätsrisikomanagement, Zinsrisiko Bankbuch & ICAAP

Termine & Optionen

DATUM	DAUER	ORT	FORMAT	PREIS
23.09.2024	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 600,-
15.05.2025	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 600,-
25.11.2025	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 600,-

Beratung & Buchung



Jeffrey Müller-Büchse

+43 1 713 80 24-38 ✉ jeffrey.mueller-buechse@ars.at