



**WISSEN  
MACHT  
ERFOLG**

# Liquiditätsrisikomanagement in der Bankenpraxis

Best-Practice: Bankspezifisches  
Stresstesting

Seminar-ID: 10888

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

Veranstaltungsformat: Seminar

## Das nehmen Sie mit

Setzen Sie sich mit den Kernelementen für ein Best Practice Steuerungsframework für das Liquiditätsrisiko auseinander. Auf Basis der neuen Risikomanagement-Verordnung, die Anfang 2014 in Kraft getreten ist, liegt der Fokus auf den Themen Cash Flow-Modellierung, Liquiditätsrisiko-Stresstesting, Liquiditätskostenverrechnung und Liquiditätsnotfallplan.

## Ihr Programm im Überblick

- 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
  - Best-Practice-Ansätze zur Entwicklung bankspezifischer Liquiditätsrisikostresstests
  - Abgleich mit der LCR
  - Erfahrungswerte aus dem EZB-Liquiditätsstresstest 2019 und der COVID-19-Krise
- 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 oder Meldewesen
- Mitarbeiter von Aufsichtsbehörden
- Geschäftsleiter und Aufsichtsräte
- Kreditinstitute und Wertpapierfirmen
- Rechtsanwaltskanzleien
- Bankprüfer

## Termine & Optionen

## Beratung & Buchung



**Jeffrey Müller-Büchse**

☎ +43 1 713 80 24-38 ✉ [jeffrey.mueller-buechse@ars.at](mailto:jeffrey.mueller-buechse@ars.at)