

Integriertes Liquiditätsrisikomanagement für Banken

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

Sie haben Fragen? ☎ +43 1 713 80 24-0 ✉ office@ars.at 📍 Schallautzerstraße 4, 1010 Wien

- Anforderungen an den Liquiditätspuffer
- Konzept des Überlebenshorizonts
- Liquiditätsrisikonotfallplan
 - Frühwarnindikatoren und Maßnahmenplan
 - Prozessuale Implikationen
- Liquiditätskosten
- Liquiditätsrisiko-Governance und Liquiditätsrisikostategie
- 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

Referent*in

MMag. Markus Seifert PRM

Fachmann für Liquiditätsrisikomanagement, Zinsrisiko Bankbuch & ICAAP

Termine & Optionen

Datum	Dauer	Ort	Angebot	Preis
07.04.2022	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 510,-
09.11.2022	1 Tag	Wien	Präsenz	€ 510,-

Sie haben Fragen?  +43 1 713 80 24-0  office@ars.at  Schallautzerstraße 4, 1010 Wien