



Die Dimensionen des Liquiditätsrisikos

ZUSAMMENFASSUNG:

In unserem Seminar erhalten Sie einen Einblick in die verschiedenen Dimensionen des Liquiditätsrisikos. Anschließend befassen wir uns ausführlich mit den regulatorischen Anforderungen. Der Schwerpunkt liegt hier auf der europäischen Umsetzung von Basel III, d. h. der CRR. Darüber hinaus werden die MaRisk und die daraus abzuleitenden Anforderungen an das Liquiditätsrisiko erörtert. Im weiteren Verlauf liegt der Fokus auf der praktischen Umsetzung der Anforderungen. In diesem Teil werden angemessene Stresstests definiert und Notfallpläne erstellt. Darüber hinaus werden Risikomanagement und -kontrolle betrachtet. Sie erfahren auch, welche Ansätze zur Bepreisung des Liquiditätsrisikos möglich sind. Abschließend gibt es Betrachtungen zum Marktliquiditätsrisiko. Neben Beispielen werden hier auch Möglichkeiten zur Risikomessung diskutiert.

ÜBERSICHT ÜBER DIE TAGESORDNUNG:

Eintägiges Seminar –

- Begriff der Liquidität
- Rechtliche Grundlagen im nationalen und internationalen Kontext (Basel III, CRD IV, KWG, CRR, LiqV, MaRisk)
- Berichtspflichten (Liquidity Coverage Ratio, Net Stable Funding Ratio)
- Stresstests und Notfallplanung
- Cashflow-Modellierung
- Risikomessung und -kontrolle (Liquiditätslückenanalyse, Liquidity-at-Risk, Liquidity-Value-at-Risk)
- Funds Transfer Pricing – Liquiditätskostenmanagement
- Marktliquiditätsrisiko

WER SOLLTE TEILNEHMEN:

Wir glauben, dass dieses Seminar für Teilnehmer aus folgenden Bereichen am nützlichsten ist:

- Risikocontrolling
- Backoffice
- Eigenhandel
- Treasury oder Wirtschaftsprüfung.
- Aufsichtsrechtliche Berichterstattung

SEMINARFORMAT:

- Dieses Seminar wird auf Englisch abgehalten.
- Diese Sitzung wird über Microsoft Teams abgehalten. Nach Abschluss Ihrer Anmeldung erhalten Sie einen Link zum Meeting.

KURSUNTERLAGEN:

- Die Sitzungen werden aufgezeichnet und können auf Anfrage am Ende des Seminars angefordert werden.
- Die Präsentationsfolien der Trainer können auf Anfrage am Ende des Seminars angefordert werden.

ZERTIFIKAT:

- Die Teilnehmer erhalten nach Abschluss des Seminars Zertifikate per E-Mail.

Haben Sie eine Frage? Senden Sie uns eine E-Mail an:
aaa.aspectadvisory.eu

<https://www.aspectadvisory.eu/academy/>