

seminare
einzel
oder
gemeinsam
buchbar!

Liquiditätsregulierung



**MMag.
Dr. Stern, MBA**
Experte
im Bereich
Bankenaufsicht
Finanzmarkt-
aufsicht
Liechtenstein



**MMag. Seifert,
PRM**
Liquiditätsrisiko-
management
Volksbank
Wien AG

seminar 1

Liquiditätsregulierung nach Basel III

20. Mai 2019, Wien

11. November 2019, Wien

jeweils von 9.00–16.30 Uhr

seminar 2

Integriertes Liquiditätsrisiko- management für Banken

21. Mai 2019, Wien

12. November 2019, Wien

jeweils von 9.00–17.00 Uhr



ARS
AKADEMIE
FÜR RECHT,
STEUERN &
WIRTSCHAFT

Von den Besten lernen.

mit MMag. Dr. Thomas Stern , MBA

IHR NUTZEN

In diesem Seminar werden Ihnen Hintergründe, aktuelle Entwicklungen und zukünftige Herausforderungen im Bereich „Liquiditätsregulierung“ aus erster Hand präsentiert. Sie erfahren die grundlegenden Konzepte sowie die wesentlichsten Positionen und Herausforderungen der europäischen Kennzahlen LCR/NSFR, inkl. ihrer Novellierungen durch CRR II, und erhalten einen umfassenden Einblick in aktuelle Entwicklungen auf europäischer und nationaler Ebene.

Ergänzend zu diesem Seminar bietet sich die Teilnahme am ARS-Seminar „Integriertes Liquiditätsrisikomanagement für Banken“ an, welches die Säule II-Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement komplementär zum vorliegenden Seminar umfassend abdeckt.

SEMINARINHALTE

- **Einleitung zum Baseler Akkord und zur europäischen Umsetzung des globalen Liquiditätsregimes**
- **Normative Adressierung des Liquiditätsrisikos durch CRD V / CRR II**
- **Liquidity Coverage Ratio (LCR) inkl. Amendment 2018**
 - Rechtsgrundlagen und Anwendungsbereich
 - Liquiditätsdeckungsanforderung
 - Konzept / detaillierter Aufbau der Kennzahl LCR
 - Hochliquide Vermögenswerte | Abflussannahmen
 - Zuflussraten | Fall / Praxisbeispiele
- **Net Stable Funding Ratio (NSFR)**
 - Rechtsgrundlagen und Anwendungsbereich nach CRR II
 - Konzept / Aufbau der Kennzahl NSFR
 - Verfügbare stabile Refinanzierung (ASF)
 - Erforderliche stabile Refinanzierung (RSF)
- **Ergänzende Überwachungsinstrumente**
 - Meldewesen „ALMM“
 - Verwendungszweck und Erläuterungen zu den „ALMM“
 - Beispiele „Maturity Ladder“ und „Anschlussfinanzierung“
- **Überblick: Säule II-Anforderungen (KI-RMV) und aufsichtlicher Überprüfungsprozess (SREP)**
 - Anforderungen an den Liquiditätspuffer
 - Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement
 - Europäische Rahmenbedingungen Li-SREP (EBA, SSM)
 - Einbettung der Li-SREPs in die Säule II
 - Anwendungsumfang – Konnex zwischen ICAAP und ILAAP im Li-SREP
 - Praktische Umsetzung
- **Exkurse (Bei Bedarf & Zeit)**
 - Zusammenhänge mit
 - Abwicklungsregime
 - Einlagensicherungssystem
 - systemischen Risiken

IHR NUTZEN

Im Seminar setzen Sie sich mit den Kernelementen für ein Best-Practice-Steuerungsframework für das Liquiditätsrisiko auseinander. Der Fokus liegt insbesondere auf den Themen Liquiditätsablaufbilanz, Cash Flow-Modellierung, Liquiditätsrisiko-Stresstesting, Liquiditätspuffer und Liquiditätsnotfallplan sowie die Integration dieser Themen in einen bankübergreifenden ILAAP (Internal Liquidity Adequacy Process). Das Seminar wird ergänzt um Erfahrungswerte aus aufsichtlichen On-Site-Prüfungen und aktuellen EZB-Anforderungen zum Liquiditätsrisiko.

Ergänzend zu diesem Seminar bietet sich die Teilnahme am Seminar „Liquiditätsregulierung nach Basel III“ an, welches die Säule I-Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement komplementär zum vorliegenden Seminar umfassend abdeckt. Über beide Seminartage hinweg erhalten Sie einen grundlegenden Überblick über das Thema Liquiditätsrisiko.

SEMINARINHALTE

■ 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 auf dem EZB Liquiditätsstresstest 2019

■ 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

Jetzt anmelden!

office@ars.at +43 1 713 80 24-29 DW-14

Seminar 1 Liquiditätsregulierung nach Basel III

- 20. Mai 2019, Wien
- 11. November 2019, Wien

Seminar 2 Integriertes Liquiditätsrisikomanagement für Banken

- 21. Mai 2019, Wien
- 12. November 2019, Wien

Sie können an den angeführten Terminen nicht teilnehmen?
Bestellen Sie die Seminarunterlagen je nach Verfügbarkeit zu einem vergünstigten Preis! Kontaktieren Sie uns!

Ort ARS Seminarzentrum, Schallauterstraße 2-4, 1010 Wien

Uhrzeit Seminar 1 von 9.00-16.30 Uhr / Seminar 2 von 9.00-17.00 Uhr

... und bin einverstanden, dass meine Daten elektronisch gespeichert werden und ich per E-Mail über weitere Veranstaltungen informiert werde. Als Gerichtsstand wird Wien vereinbart.

TEILNEHMER/IN

KonzipientIn BerufsanwärterIn

Name / Vorname / Titel

Aufgabenbereich / Abteilung

Tel. Mobil

E-Mail

FIRMA Beschäftigte bis 100 100-200 über 200

Branche/Firma

Straße, Postfach

PLZ, Ort E-Mail für Rechnungsversand

Datum Unterschrift

IHRE INVESTITION / ERMÄSSIGUNGEN

€ 480,- exkl. USt. (pro Seminar)

- 12 % (per TN) ab 5 TeilnehmerInnen eines Unternehmens
- 10 % (per TN) ab 3 TeilnehmerInnen eines Unternehmens
- 20 %* für RA-KonzipientInnen, WT-BerufsanwärterInnen, NO-KandidatInnen
- 5 % **Ermäßigung bei Buchung beider Seminare!** (für 1 Person)

Ermäßigungen, Rabatte, Frühbucherbonus etc. sind nicht addierbar! *Ermäßigung nur gegen Vorlage von Legitimation/Bescheid.

Gebühr inkl. Seminarunterlage, Begrüßungskaffee, Erfrischungsgetränken, Mittagessen und exkl. 20 % USt. Anmeldungen werden in der Reihenfolge des Eintreffens und nach Maßgabe freier Plätze berücksichtigt. Wir ersuchen Sie, nach Erhalt der Rechnung die Teilnahmegebühr bis zum Seminartermin zu überweisen. Die Rechnung wird per E-Mail versendet. Seminarunterlagen können nicht retourniert werden!

Bitte haben Sie Verständnis, dass bei Stornierungen ab 14 Tage vor Seminarbeginn 50 % des Seminarbetrages, bei Stornierungen oder Nichterscheinen am Veranstaltungstag die volle Gebühr in Rechnung gestellt wird. Bei jeder Stornierung beträgt die Bearbeitungsgebühr € 40,-. Bei einer Umbuchung auf einen Folgetermin bleibt die ursprüngliche Rechnung inkl. der Fälligkeit gültig. Zusätzlich wird eine Gebühr von € 20,- exkl. USt. (ausgenommen am Seminarort: 15 % Aufschlag) in Rechnung gestellt. Stornierungen können ausschließlich schriftlich entgegengenommen werden! Selbstverständlich können Sie jedoch gerne eine Ersatzperson nominieren. Die Veranstalter behalten sich vor, Seminare aus wichtigen Gründen zu verschieben sowie Programmänderungen vorzunehmen. Sollten Sie spezielle Bedürfnisse (Barrierefreiheit, Lebensmittelunverträglichkeiten etc.) haben, geben Sie uns diese bitte bekannt. Irrtümer und Preisänderungen vorbehalten.

ARS TEAM

Inhalt / Konzeption: Daniela Wastl, MA, **Projektorganisation:** Nora Prochaska



ARS ist ÖCERT-Qualitätsanbieter!

WER MUSS INFORMIERT SEIN

- ✓ BankmitarbeiterInnen im Risikocontrolling bzw. im Bereich Treasury / ALM oder Meldewesen
- ✓ MitarbeiterInnen von Aufsichtsbehörden
- ✓ GeschäftsleiterInnen und Aufsichtsräte
- ✓ Kreditinstitute und Wertpapierfirmen
- ✓ Rechtsanwaltskanzleien
- ✓ BankprüferInnen

Details & weitere Infos auf

ars.at

