

Intensivkurs zur LCR-Steuerung

Effiziente Steuerung der LCR in Zeiten von ILAAP und NSFR

Inklusive
Praxisbeispiele
in Excel

www.exbase.de/lcr

Finanzinstitute sind gefordert, ihre Liquiditätsstrategie zu überdenken und neue Anforderungen an die Berechnung und Meldung der LCR zu integrieren.

Themen der Veranstaltung

- Liquiditätsregulierung: Aktueller Stand und europäische Umsetzung
- Kalibrierung und Mechaniken der LCR
- Statische und dynamische LCR-Steuerung
- Wirkung ausgewählter Geschäfte
- LCR Vorschau und Meldung der LCR

„Sehr gute Vermittlung der LCR mit sehr hohem praktischen Bezug.“

(Eugen Rabe, Regulatory Analytics & Policies, Commerzbank AG.)

„Der Intensivkurs zur LCR-Steuerung war für mich eine sehr gute Auffrischung und Vertiefung der Thematik LCR.“

(Ronald Morche, BSM GmbH.)

„Vorkenntnisse der LCR/NSFR und Produktkenntnisse sind notwendig. Sehr guter Einblick in die Auswirkungen von geschäftspolitischen Entscheidungen.“

(Ansgar Stillfried, Abteilungsleitung Liquiditätsreporting, Commerzbank AG.)

Ihre Referenten



Professor Dr. Christian Schmaltz
EADA Business School



Sonja Reinhard
Bundesbankdirektorin
Deutsche Bundesbank

Termine in Frankfurt am Main (Teilnahme vor Ort oder per Webinar)

25. Januar 2021 | 29. Juni 2021 | 03. Dezember 2021

KURSBESCHREIBUNG

Im Gegensatz zur LiqV ist die LCR konservativer kalibriert, volatiler und komplexer, um regulatorischer Arbitrage vorzubeugen. Dies verursacht höhere Pufferkosten und erfordert eine effizientere Steuerung. Wie die heutigen und zukünftigen Kennzahlen auf verschiedene Produkte reagieren, muss verstanden und mit Kosteninformationen verbunden werden.

Daher befasst sich dieser Kurs mit dem Einfluss der Produktwelt des Treasury auf die LCR und den Mechaniken der LCR-Meldung. Darüber hinaus werden weitere steuerungsrelevante Aspekte wie Transferpricing, ILAAP (Säule 2), NSFR und aktuelle Entwicklungen (CRR II, LCR Korrigendum...) thematisiert.

AGENDA

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

09.00

Beginn der Veranstaltung

- Begrüßung und Programmübersicht
- Abstimmung der Kursinhalte mit den Teilnehmenden

09.15

Liquiditätsregulierung - Aktueller Stand und europäische Umsetzung

- Die Liquiditätsquoten LCR und NSFR
- Zusätzliche Parameter der Liquiditätsüberwachung (ALMM)
- Aktuelle Anforderungen und Anwendungsfragen
- Einhaltung und Meldung der LCR
- Liquiditätswaiver

Sonja Reinhard, Deutsche Bundesbank

10.30 Kaffeepause

10.45

Interaktion mit anderen regulatorischen Initiativen

- Margining und Aktivbelastungen
- LCR-Beobachtungskennzahlen und Fundingpläne
- MaRisk-Liquiditätsanforderungen
- SREP-Anforderungen

12.15 Gemeinsames Mittagessen

13.15

LCR-Mechanik

- Eingangsbeispiel zur Veranschaulichung in Excel
- Pufferbestandteile sowie Zu- und Abflüsse
- Caps und Auflösung von kurzfristigen besicherten Geschäften
- Wirkungsweise der Grundgeschäfte: Kauf und Verkauf von Wertpapieren, unbesicherte und besicherte Aufnahme/Anlage, Sicherheitenwaps

14.45 Kaffeepause

15.00

Statische und dynamische LCR-Steuerung

- Kosten der LCR-Einhaltung
- Senkung der Pufferkosten
- LCR-Strategien
- Kostenoptimale Einhaltung der LCR
- LCR-Vorschau
- Warum eine LCR-Vorschau aufsichtsseitig gewünscht ist.
- Vorschau für die nächsten 12 Meldestichtage

Verursachungsgerechte Allokation der LCR-Kosten

- LCR-kompatible Reserve und ihre Kosten
- Allokation von Pufferkosten (indirekte Liquiditätskosten)
- MaRisk- vs. LCR-Pufferkosten
- Makro- vs. Mikroallokation

16.45 Zusammenfassung und Ausblick

17.00 Ende des Kurses

HINWEISE ZUR VERANSTALTUNG

Alle Teilnehmenden erhalten die Präsentation und die Excel-Dateien als Kursunterlage. Um nahe an den Originalpublikationen zu bleiben, sind die Unterlagen von Prof. Dr. Schmaltz in englischer Sprache verfasst. Er referiert auf Deutsch. Bitte bringen Sie zur Veranstaltung Ihren Laptop mit, um die kursbegleitenden Excel-Übungen ausführen zu können.

NACHBETREUUNG

Gerne steht Ihnen Prof. Dr. Schmaltz für drei Monate nach dem Kurs in gewissem Umfang für Fragen zu Kursinhalten zur Verfügung.

WER SOLLTE TEILNEHMEN?

Dieser Intensivkurs richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus Banken und Sparkassen sowie anderen Finanzdienstleistungsunternehmen mit folgenden Schwerpunkten:

- Treasury (Liquiditätssteuerung)
- Meldewesen
- Risikocontrolling (Liquiditätsrisiko)
- Interne Revision
- Händler (insb. Repodesks, unsecured money markets, Derivatehändler)
- Finanzen (Transferpricing, Ergebniscontrolling)

IHRE REFERENTEN



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Gastprofessor für Finance an der EADA Business School und geschäftsführender Partner in der Aspect Advisory Group. In Lehre und Forschung befasst er sich intensiv mit der Steuerung und Regulierung von Banken. Als Berater betreut er viele europäische Banken im Risikomanagement und in der Umsetzung regulatorischer Anforderungen. Seine Projekterfahrung reicht im Liquiditätsrisiko von der Modellierung der Zahlungsströme einzelner Instrumente bis hin zu einem integrierten Liquiditätsstresstest.



Sonja Reinhard ist Bundesbankdirektorin in der Abteilung Bankenaufsichtsrecht und internationale Bankenaufsicht. Schwerpunkte ihrer Tätigkeit bilden Grundsatzfragen zur internationalen und europäischen Liquiditätsregulierung. Dabei befasst Sie sich insbesondere mit der Umsetzung von Basel III in europäisches Recht und hat bei der Europäischen Kommission am Entwurf der europäischen Liquiditätsregeln mitgearbeitet. Als Vertreterin der Deutschen Bundesbank in der EBA Subgroup on Liquidity ist sie an der Erarbeitung Technischer Standards beteiligt und als Mitglied des EBA Q&A Networks für Auslegungsfragen und das relevante Meldewesen zuständig.

Bei Interesse an einem Online-Training oder Inhouse-Seminar freuen wir uns auf Ihre Anfrage an info@exbase.de.

Anmeldung „Intensivkurs zur LCR-Steuerung“

Ja, hiermit melde ich mich für folgenden Termin an:

- 25. Januar 2021, Frankfurt am Main und per Webinar
- 29. Juni 2021, Frankfurt am Main und per Webinar
- 03. Dezember 2021, Frankfurt am Main und per Webinar

Die Teilnahmegebühr beträgt pro Person und Termin **EUR 950** zzgl. MwSt.

Gratisticket

Melden sich drei Personen eines Instituts oder Unternehmens für den gleichen Termin an, besucht die dritte Person den Kurs gratis.

1. PERSON

Anrede, Titel

Name, Vorname

Position, Abteilung

E-Mail

Firma

Straße, Nr.

Postfach

PLZ, Ort

Land

2. PERSON

Anrede, Titel

Name, Vorname

Position, Abteilung

E-Mail

RECHNUNGSDetails

Bestellreferenz

MwSt.-Nr.

Firma

Abteilung

Straße, Nr.

PLZ, Ort

Datum, Unterschrift

ANMELDUNG

Web www.exbase.de/lcr
Telefon +49 (0)7531 922 82 33
E-Mail info@exbase.de
Post Exbase
Hindenburgstraße 2
78467 Konstanz
Deutschland

VERANSTALTUNGSORTE

Der Kurs findet in gehobenem Ambiente in einem 4-Sterne-Hotel statt.
Weitere Details senden wir Ihnen vor dem jeweiligen Termin per E-Mail.

TEILNAHMEBEDINGUNGEN

Geltungsbereich
Diese Teilnahmebedingungen regeln das Vertragsverhältnis zwischen dem Veranstalter und dem Teilnehmer. Der Teilnehmer erkennt mit seiner Anmeldung diese Teilnahmebedingungen an. Abweichende Allgemeine Geschäftsbedingungen des Teilnehmers haben keine Gültigkeit.

Teilnahmegebühr
Die Teilnahmegebühr beinhaltet die Teilnahme für eine Person. Sie versteht sich inklusive schriftlicher Unterlagen, Mittagessen und Tagungsgetränken zzgl. MwSt. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Diese ist direkt nach Erhalt, in jedem Fall vor Eintritt in die Veranstaltung, fällig.

Anmeldung
Die Anmeldung kann schriftlich via Internet, E-Mail, Fax oder per Post oder mündlich per Telefon erfolgen. Sie ist, vorbehaltlich gesetzlicher Widerrufsrechte, verbindlich. Jede Anmeldung erlangt erst durch schriftliche Bestätigung seitens des Veranstalters Gültigkeit. Die Veranstaltungsteilnahme setzt die vollständige Bezahlung der Teilnahmegebühr voraus.

Urheberrecht
Alle im Rahmen der Veranstaltungen ausgegebenen Unterlagen sowie anderweitig erworbene Artikel sind urheberrechtlich geschützt. Vervielfältigungen und anderweitige Nutzung sind schriftlich durch den Veranstalter zu genehmigen.

Rücktritt des Teilnehmers
Sollte der Teilnehmer an der Teilnahme verhindert sein, so ist er berechtigt jederzeit ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer zu benennen. Darüber hinaus ist eine vollständige Stornierung bis 30 Tage vor Beginn der Veranstaltung kostenlos möglich. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Bei späterem Rücktritt oder Nichterscheinen wird die gesamte Teilnahmegebühr fällig.

Programmänderungen und Absagen
Der Veranstalter behält sich vor, Änderungen am Inhalt des Programms sowie Ersatz und Weglassen der angekündigten Referenten vorzunehmen, wenn der Gesamtcharakter der Veranstaltung gewahrt bleibt. Muss eine Veranstaltung aus wichtigem Grund oder aufgrund höherer Gewalt (kriegerische Auseinandersetzungen, Unruhen, terroristische Bedrohungen, Naturkatastrophen, politische Beschränkungen, erhebliche Beeinflussung des Transportwesens usw.) abgesagt oder verschoben werden, so wird der Veranstalter die zu diesem Zeitpunkt angemeldeten Teilnehmer umgehend schriftlich oder mündlich benachrichtigen. Bereits eingegangene Zahlungen werden für eine zukünftige Veranstaltung gutgeschrieben oder bei einer Terminverschiebung auf den neuen Termin ausgestellt. Kosten seitens des Teilnehmers, die mit der Absage einer Veranstaltung verbunden sind (z. B. Reise- und Übernachtungskosten), werden nicht erstattet.

Haftung
Alle Veranstaltungen werden sorgfältig recherchiert, aufbereitet und durchgeführt. Sollte es dennoch zu Schadensfällen kommen, so übernimmt der Veranstalter keine Haftung für die Vollständigkeit und inhaltliche Richtigkeit in Bezug auf die Vortragsinhalte und die ausgegebenen Unterlagen.

Datenschutz
Überlassene persönliche Daten behandelt der Veranstalter in Übereinstimmung mit den geltenden datenschutzrechtlichen Bestimmungen. Sie werden zum Zwecke der Leistungserbringung elektronisch gespeichert. Einblick und Löschung der gespeicherten Daten kann jederzeit gefordert werden. Anfragen bitte per E-Mail an: info@exbase.de.

Exbase
Banking and Finance