

Intensivkurs zur LCR-Steuerung

Methoden und Strategien zur Erfüllung der aufsichtlichen Anforderungen und zur Integration in die Liquiditätssteuerung

www.exbase.de

Finanzinstitute sind gefordert, ihre Liquiditätsstrategie zu überdenken, neue Anforderungen an die Berechnung und Meldung der LCR in ihre Systeme zu integrieren und eine LCR-Vorschau zu implementieren.

Ihr Seminarleiter



Professor Dr. Christian Schmaltz
Aarhus University

Eckpunkte des Inhouse-Seminars

- Kalibrierung und Mechaniken der LCR
- Dynamische LCR-Steuerung
- Wirkung ausgewählter Geschäfte wie Kauf / Verkauf von HQLA, besicherte / unbesicherte Aufnahmen und Anlagen
- LCR-Vorschau: Wo steht meine LCR an den kommenden Stichtagen?
- LCR im Zeitablauf auf Zielkorridor aussteuern

SEMINARBESCHREIBUNG

In diesem Inhouse-Seminar erfahren Sie, welche Anforderungen die LCR an Ihr Institut stellt und wie Sie strategisch und methodisch bei der Steuerung der LCR vorgehen können. Ein besonderer Fokus des Seminars liegt auf den Mechaniken der LCR, dem Verhalten der Kennzahl über die Zeit und den Möglichkeiten, wahlweise die LCR (mit Nebenbedingung GuV) oder die GuV (mit Nebenbedingung LCR) auszusteuern.

THEMEN DES SEMINARTAGES

08.30 Empfang und Ausgabe der Seminarunterlagen

09.00

Regulierung der Bankenliquidität

- Überblick über den Stand der Regulierung (Säule 1: LCR/NSFR, Säule 2: MaRisk/SREP, Säule 3: Offenlegung)
- Regulatorische Reportinganforderungen (LCR, LCR-Überwachungskennzahlen, NSFR)
- Anforderungen im Rahmen der Asset Encumbrance, EBA Fundingpläne
- Interaktion zw. Säule 1 (LCR) und Säule 2 (Internes Liquiditätsmodell)

LCR: Kalibrierung und Mechaniken

- LCR-Formel (inkl. Beispiel)
- LCR-Kalibrierung
- Behandlung der Grundprodukte
 - Liquide Wertpapiere
 - Besicherte Aufnahmen und Anlagen
 - Unbesicherte Aufnahmen (Repos) und Anlagen (Reverse Repos)
 - Collateralswaps

10.30 Kaffeepause

10.45

LCR: Kalibrierung und Mechaniken (cont'd)

- CF-Netting
- HQLA-Caps und Unwinding
- Pufferoptimierung
 - Makroallokation
 - Mikroallokation
 - Refinanzierungsmöglichkeiten

12.15 Mittagspause

13.30

Dynamische LCR-Steuerung

- Systematik der LCR-Strategien
- Statische LCR-Steuerung
- Zukünftige Bilanzen
- LCR-Forecast / -dynamik

Heutige und zukünftige Wirkung ausgewählter Geschäfte

- Kauf / Verkauf von HQLA
- Unbesicherte Aufnahmen und Anlagen
- Besicherte Aufnahmen (Repos) und Anlagen (Reverse Repos)
- Collateralswaps

15.00 Kaffeepause

15.15

Optimierte LCR-Steuerung (Diskussion)

- Aussteuerung der LCR in einem Zielkorridor
- Messung des GuV-Beitrags der Strategien
- Optimierte Aussteuerung

16.45 Zusammenfassung und Ausblick

17.00 Ende des Seminars

IHR SEMINARLEITER



Prof. Dr. Christian Schmaltz ist Assistant Professor für Finance an der Aarhus University. In Lehre und Forschung befasst er sich intensiv mit der Steuerung und Regulierung von Banken. Während seiner Tätigkeit als Consultant bei True North Partners betreute er viele europäische Banken im Risikomanagement und in der Umsetzung regulatorischer Anforderungen. Als gefragter Referent spricht er regelmäßig auf Konferenzen und gibt Seminare zu aufsichtsrechtlichen Themen. Seine Projekterfahrung reicht im Liquiditätsrisiko von der Modellierung der Zahlungsströme einzelner Instrumente bis hin zu einem integrierten Liquiditätsstresstest.

SEMINARUNTERLAGE

Alle Teilnehmenden erhalten die Präsentation und die Excel-Dateien als Seminarunterlage. Um nahe an den Originalpublikationen zu bleiben, sind die Unterlagen von Prof. Dr. Schmaltz in englischer Sprache verfasst. Er referiert in Deutsch.

WER SOLLTE TEILNEHMEN?

Diese Veranstaltung richtet sich an Fach- und Führungskräfte mit folgenden Schwerpunkten:

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