



S&P Unternehmerforum ist ein zertifizierter Weiterbildungsträger nach AZAV, Ö-Cert und DIN EN ISO 9001 : 2008. Wir erfüllen die Qualitäts-Anforderungen des ESF.

**S & P Unternehmerforum**  
Seminare - Inhouse-Trainings

## MaRisk Update – Neue Anforderungen an das Risikomanagement



- > Diversifikation von Refinanzierungsquellen und der Liquiditätsreserve
- > Asset Encumbrance: Was ist zu beachten?
- > Optimale Verzahnung der Basel III- und MaRisk-Anforderungen
- > Liquiditätssteuerung mit LCR, NSFR und MaRisk 6.0
- > Liquiditätsmonitoring mit ILAAP

### Zielgruppe:

- > Vorstände und Geschäftsführer bei Banken, Finanzdienstleistern, Leasing- und Factoring-Gesellschaften
- > Führungskräfte und Spezialisten aus den Bereichen Treasury und Risikocontrolling

### Ihr Nutzen

MaRisk 2016: Neue Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement

MaRisk 2016: Refinanzierungsplan, Transferpreise, Liquiditätsreserven und Stresstests

Erfolgreiche Liquiditätssteuerung unter Basel III und MaRisk 6.0

### Ihr Vorsprung:

Jeder Teilnehmer erhält mit dem Seminar folgende S&P-Produkte:

- + **Muster-Rahmenbedingungen „Liquiditätsrisikomanagement gemäß MaRisk“**
- + **128 Punkte** Check: „Liquiditäts-Steuerung und Liquiditäts-risikomanagement“
- + S&P Tool „Liquiditätspreis-Simulator“
- + S&P Tool Basel III-Simulator für die optimale Bilanzstruktur gemäß CRD IV und CRR

### Termine:

10.04.2018  
**München**

17.04.2018  
**München**

10.07.2018  
**München**

23.10.2018  
**Frankfurt am Main**

### Preis:

**690,00 €**  
Zzgl. 19% MwSt.

Im Preis enthalten:  
Teilnehmerunterlagen als PDF,  
3-Gänge-Menü, Kaffee, Tee,  
Erfrischungsgetränke und  
Snacks in den Pausen

**Liquiditätsrisiken  
im Fokus der  
MaRisk 2016**

## Programm

09.15 Uhr

### Begrüßung

Kaffee und Getränke

09.30 Uhr – 12.00 Uhr

### MaRisk 2016: Neue Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement

- > Anforderungen der MaRisk 2016 an die Steuerung der Liquiditätsrisiken
  - > Anforderungen an den Liquiditätsstatus, die Liquiditätsplanung sowie die Liquiditätssteuerung
  - > Diversifikation der Refinanzierungsquellen und der Liquiditätsreserve
  - > Liquiditätskennzahlen und Bemessung der Liquiditätsreserven
  - > ILAAP: 6 Monitoring-Kennzahlen zum Liquiditätsprofil
  - > Reporting zu Asset Encumbrance, Liquiditätssituation, außerbilanzielle Gesellschaftskonstruktionen, Ergebnisse der Stresstests sowie Notfallplan für Liquiditätsengpässe



MaRisk 2016:  
im Fokus  
Liquiditätsrisiken

*Die Teilnehmer erhalten die Muster-Rahmenbedingungen „Liquiditätsrisikomanagement gemäß MaRisk“ sowie 128 Punkte Check „Liquiditätssteuerung und Liquiditätsrisikomanagement“*

12.00 Uhr – 15.00 Uhr

### MaRisk 2016: Refinanzierungsplan, Transferpreise, Liquiditätsreserven und Stresstests


- > Berechnung der Liquiditätsspreads für das Kredit- und Einlagengeschäft
- > Auswahl der geeigneten Zins- und Bewertungskurven
- > Fristen- und Liquiditätstransformation: Was ist noch möglich?
- > Refinanzierungsplan: Verzahnung von Strategie, Risikoappetit, Geschäftsmodell und Überlebenshorizont
- > Bemessung der Liquiditätsreserven in normalen Marktphasen und in Stressphasen
- > Stressszenarien mit institutseigenen und marktweiten Ursachen
- > Liquidierbarkeit ohne signifikante Wertverluste

*Direkte Umsetzung in die Praxis:*

*Die Teilnehmer erhalten mit dem Seminarpreis das S&P Tool „Liquiditätspreis-Simulator“.*

13.00 Uhr – 14.00 Uhr **Gemeinsames Mittagessen**

15.00 Uhr - 17.30 Uhr **Erfolgreiche Liquiditätssteuerung unter Basel III und MaRisk 6.0**



Liquiditäts-  
steuerung  
mit LCR, NSFR  
+MaRisk 6.0

- > Passt die Liquiditätsstruktur des Unternehmens?
  - > Kurzfristige und strukturelle Steuerung der Liquidität
    - > Verschärfte Anforderungen an die Liquiditätsrisikotragfähigkeit
    - > Steuerung mit den Liquiditätskennzahlen Liquidity Coverage Ratio (LCR) und Net Stable Funding Ratio (NSFR)
    - > Maßnahmen zur Verbesserung der NSFR und LCR
    - > Simulation der optimalen Bilanzstruktur
  - > Vermeiden von Wettbewerbsnachteilen durch Auswahl der „richtigen“ Fundingkurven
- > Welche Produkte sind künftig regulatorisch teuer?

*Die Teilnehmer erhalten mit dem Seminarpreis das S&P Tool „Basel III-Simulator und CRD IV und CRR“.*

*Es werden Praxisfälle zu den wichtigsten Kennzahlen trainiert. Die Teilnehmer erhalten konkrete Vorschläge für die Optimierung der Bilanzstruktur und für Verbesserungen in der laufenden Liquiditätssteuerung.*

17.30 Uhr **Zusammenfassung und offene Fragen**

## Referenten & Fachbereiche



### Fachbereich Depot A-Management und Compliance

Herr **Achim Schulz** gründete Schulz & Partner im Jahr 2007. Er berät seit 22 Jahren Banken, Finanzdienstleister sowie Leasing- und Factoringgesellschaften.

Zu den wesentlichen beruflichen Stationen zählen die Bankenprüfung, Bankenberatung sowie die Mittelstandsfinanzierung und Unternehmensberatung.

Von 2000 bis 2006 leitete er das operative Bankgeschäft als Vertriebs-, Handels- und Sanierungsvorstand bei Regionalbanken.

### Fachbereich Risikomanagement und Basel III

Herr **Alexander Schneider** ist seit über 20 Jahren für Banken, Finanzdienstleister und Fondsgesellschaften tätig. Als Compliance- und Geldwäschebeauftragter war er für eine Großbank weltweit für die Einhaltung der Konzernstandards verantwortlich.

**Frau Anne Unger** verfügt über ein exzellentes Projektmanagement-Netzwerk.

Sie betreut MaRisk-Projekte zu Produkteinführungen sowie zur Prozessoptimierung bei Banken und Dienstleistern.

**Rechtsanwalt Alexander Suck** ist ein erfahrener Experte mit den Schwerpunkten Gesellschafts- und Strafrecht.

Er berät Unternehmen bei der compliance-konformen Vertragsgestaltung.

Das S&P Team betreut aktuell folgende **Projektschwerpunkte:**

- > aufsichtsrechtliche Umsetzung der MaRisk
- > Implementierung von Risikomanagement-, Compliance- und Anti-Geldwäsche-Systemen
- > Neujustierung der Kreditentscheidungsprozesse im Depot A- und Asset Management
- > Einsatz des S&P Tools zum Liquiditätsfunding und Treasury-Management
- > MaRisk- und Compliance-Checks
- > Einsatz der S&P Tools zur prüfungssicheren Umsetzung der aufsichtsrechtlichen Anforderungen

### Kundenstimmen zum S&P Unternehmerforum

- > Referenten mit hohem Praxisbezug
- > Aktuelles Fachwissen kompakt und spannend aufbereitet
- > Wertvolle Umsetzungs-Tipps aus der Praxis für die Praxis
- > Fallstudien, Checklisten und Tools für eine sichere und schnelle Umsetzung

## Leistungsangebot von Schulz & Partner

- > MaRisk- und Risikomanagement-Check
- > Implementierung von Compliance- und Anti-Geldwäschesystemen
- > Change und Lean Management
- > Aufbau und Weiterentwicklung von Internen Kontrollsystemen
- > Operative Umsetzungsbegleitung und Interim-Management
- > Vertriebs- und Ertragssteigerungs-Programme
- > Outsourcing der Internen Revision
- > Geschäftsprozessoptimierung

---

## Ihr Vorsprung in der Praxis



Gerne informieren wir Sie über weitere Seminare und Inhouse-Trainings. Sie erreichen uns auch über [www.sp-unternehmerforum.de](http://www.sp-unternehmerforum.de)

---

## Teilnehmer haben auch folgende Seminare gebucht:

- > **MaRisk- Compliance im Fokus der Bankenaufsicht**  
Umsetzung der neuen Anforderungen aus den MaRisk 6.0, CRD IV, §25 KWG
- > **MaRisk-Compliance: Aufbauseminar für Compliance Officer**  
Risk-Assessment – IKS-Schlüsselkontrollen – Compliance-Reporting
- > **Depot A: im Fokus der Bankenaufsicht**  
Beurteilungsstandards, Checklisten und Musterbeschlüsse  
Rating-Plausibilisierung und zuverlässige Kreditanalyse im Depot A
- > **Geldwäsche update**  
Neuerungen 2018 – sichere Geldwäscheprävention – Risiko-Workshop
- > **Professionelles Projektmanagement**  
Erfolgreiche Projektumsetzung in der Praxis

Anmeldung online:  
<https://sp-unternehmerforum.de/seminar-formular/>  
oder E-Mail an: [service@sp-unternehmerforum.de](mailto:service@sp-unternehmerforum.de)

S & P Unternehmerforum  
Seminare - Inhouse Trainings

## MaRisk Update – Neue Anforderungen an das Risikomanagement

Seminarpreis: 690,- € zzgl. 19 % MwSt. - Produkt-Nr. A10

Es gelten unsere AGB's, welche Sie unter [www.sp-unternehmerforum.de](http://www.sp-unternehmerforum.de) einsehen können.



Förderung möglich! Teilnehmer aus fast allen Bundesländern können sich vom Europäischen Sozialfonds fördern lassen. Die Fördervoraussetzungen finden Sie auf unserer Förder-Landkarte unter [www.sp-unternehmerforum.de/seminarfoerderung/](http://www.sp-unternehmerforum.de/seminarfoerderung/)

Ja, ich nehme am folgenden Seminar teil (bitte auswählen):

- |                                     |                   |                          |  |
|-------------------------------------|-------------------|--------------------------|--|
| <input type="checkbox"/> 10.04.2018 | München           | <input type="checkbox"/> | Nein, ich kann leider nicht teilnehmen. Bitte informieren Sie mich über weitere Veranstaltungstermine  |
| <input type="checkbox"/> 17.04.2018 | München           | <input type="checkbox"/> | Nein, ich kann leider nicht teilnehmen. Bitte übersenden Sie uns die Vortragsunterlagen als PDF-Version gegen eine Schutzgebühr von 390,00 € zzgl. MwSt. |
| <input type="checkbox"/> 10.07.2018 | München           |                          | (Versand der Unterlagen erfolgt nach Eingang der Zahlung und Stattfinden des ersten Seminartages).   |
| <input type="checkbox"/> 23.10.2018 | Frankfurt am Main |                          |  |

Wie sind Sie auf uns aufmerksam geworden? Vielen Dank für Ihre Auskunft.

- |   |                                   |   |  |
|---|-----------------------------------|---|--|
| <input type="checkbox"/> Empfehlung                     | <input type="checkbox"/> Internet | <input type="checkbox"/> Newsletter               | <input type="checkbox"/> Seminarportal |
| <input type="checkbox"/> Telefon / Persönlicher Kontakt |                                   | <input type="checkbox"/> Persönliches Anschreiben |  |
| <input type="checkbox"/> ESF-Förderung ist beantragt    |                                   |   |  |



Bei Anmeldung eines 2. Teilnehmers erhalten Sie jeweils 10% Preisnachlass.

(Bitte legen Sie eine Kopie des Antrages bei)

Name und Position im Unternehmen

Name und Position im Unternehmen

Unternehmen

Anzahl der Beschäftigten

Straße, PLZ / Ort

Telefon

Telefax

E-Mail

Datum / Unterschrift

Diese Anmeldung wird durch meine Unterschrift verbindlich!

Service   
089/452 429 70-100