



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

Liquiditätssteuerung – MaRisk 2017



- > 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 2017: Neue Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement

MaRisk 2017: 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: „Liquiditätssteuerung und Liquiditätsrisikomanagement“
- + 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
- 11.12.2018
Frankfurt am Main

Liquiditätsrisiken
im Fokus der
MaRisk 2017

Preis:

690,00 €
Zzgl. 19% MwSt.

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

Programm

09.15 Uhr

Begrüßung

Kaffee und Getränke

09.30 Uhr – 12.00 Uhr

MaRisk 2017: Neue Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement

- > Anforderungen der MaRisk 2017 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 2017:
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 2017: 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
- > Operative Umsetzungsbegleitung und Interim-Management
- > Implementierung von Compliance- und Anti-Geldwäschesystemen
- > Vertriebs- und Ertragssteigerungs-Programme
- > Change und Lean Management
- > Outsourcing der Internen Revision
- > Aufbau und Weiterentwicklung von Internen Kontrollsystemen
- > 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

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

Liquiditätssteuerung – MaRisk 2017

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

Es gelten unsere AGB's, welche Sie unter 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/

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 | | |
| <input type="checkbox"/> 11.12.2018 | 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