



Treasury – Management mit LCR und NSFR



- > Einrichtung eines MaRisk-konformen Verrechnungssystems für Liquiditätskosten
- > Umsetzung der 5 maßgeblichen CEBS-Leitlinien
- > Verrechnungssysteme für Banken der Gruppe 1 bis 3 im Überblick
- > Optimale Verzahnung der Basel III- und MaRisk-Anforderungen
- > Musteranweisung für ein MaRisk-konformes Liquiditätsmanagement

Zielgruppe:

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

Ihr Nutzen

Anforderungen an ein Liquiditätstransfer-Preissystem

MaRisk-konformes Liquiditätstransfer-Preissystem – Leitfaden für die Praxis

Erfolgreiche Liquiditätssteuerung unter Basel III und MaRisk 5.0 – Auswahl der „richtigen“ Funding-Kurve

Ihr Vorsprung:

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

+ Muster-Rahmenbedingungen „Liquiditätsrisikomanagement gemäß MaRisk“

+ Checkliste „Liquiditätssteuerung und Liquiditätsrisikomanagement“

+ S&P Tool „Liquiditätspreis-Simulator“

+ S&P Tool Basel III-Simulator für die optimale Bilanzstruktur gemäß CRD IV und CRR

Termine:

11.05.2016
Frankfurt

13.09.2016
München

03.11.2016
Frankfurt

Service 
089/452 429 70-100

Preis:

690,00 €
Zzgl. 19% MwSt.

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

Banksteuerung mit
LCR und NSFR

Programm

09.15 Uhr

Begrüßung

Kaffee und Getränke

09.30 Uhr – 11.00 Uhr

Anforderungen an ein Liquiditätstransfer-Preissystem

- > Anforderungen an den Liquiditätsstatus, die Liquiditätsplanung sowie die Liquiditätssteuerung
- > Umsetzung der 5 maßgeblichen CEBS-Leitlinien
 - > Liquiditätskennzahlen und Bemessung der Liquiditätsreserven
 - > Aufbau eines Verrechnungssystems für Liquiditätskosten, Nutzen und Risiken
 - > Ausgestaltung und Definition der Verrechnungssysteme für Banken der Gruppen 1 bis 3
- > Vereinfachte Umsetzung bei kleinteiligem Kundengeschäft
- > Reporting zur Liquiditätssituation, außerbilanzielle Gesellschaftskonstruktionen, Ergebnisse der Stresstests sowie Notfallplan für Liquiditätsengpässe

Die Teilnehmer erhalten die Muster-Rahmenbedingung „Liquiditätsrisikomanagement gemäß MaRisk“ sowie die Checkliste „Liquiditätssteuerung und Liquiditätsrisikomanagement“

11.00 Uhr – 11.30 Uhr

Diskussion und Erfahrungsaustausch

11.30 Uhr – 13.00 Uhr

MaRisk-konformes Liquiditätstransfer-Preissystem – Leitfaden für die Praxis

- > Berechnung der Liquiditätsspreads für das Kredit- und Einlagengeschäft
- > Auswahl der geeigneten Zins- und Bewertungskurven
- > Renaissance der Marktzinsmethode ?
- > Einfaches Verrechnungssystem der Gruppe 3
- > Liquiditätskosten-Verrechnungssystem der Gruppe 2
- > Verzahnung von Marktzinsmethode und Liquiditätstransfer-Preissystem



Liquiditäts-Pricing
nach MaRisk


- > Beiträge aus der Fristentransformation und der Liquiditätstransformation
- > Lösungsvorschläge für das variable Kredit- und Einlagengeschäft

Direkte Umsetzung in die Praxis:

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

13.00 Uhr – 14.00 Uhr **Gemeinsames Mittagessen**

14.00 Uhr - 17.30 Uhr **Erfolgreiche Liquiditätssteuerung unter Basel III und MaRisk 5.0 – Auswahl der „richtigen“ Funding-Kurve**



**Liquiditäts-
steuerung
mit LCR, NSFR
+MaRisk 5.0**

- > 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 ?
- > Steuerungsmaßnahmen bei aktivlastigen und bei passivlastigen Bilanzstrukturen

Die Teilnehmer erhalten mit dem Seminarpreis das S&P Produkt „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, Versicherungen 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

Frau Chiny Wirthmüller und **Herr Andreas Leitner** sind als Consultants und Referenten bei Schulz & Partner für Banken, Sparkassen sowie Leasing- und Factoring-Gesellschaften tätig.

Als Spezialisten für Risiko-Management haben sie verschiedene Planungs- und Steuerungs-Systeme mit dem Fokus Treasury aufgebaut.

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

Teilnehmer haben auch folgende Seminare gebucht:

- > **MaRisk- Compliance im Fokus der Bankenaufsicht**
Umsetzung der neuen Anforderungen aus den MaRisk 5.0, CRD IV, §25 KWG neu
- > **MaRisk-Compliance – WpHG-Compliance – Vertriebsbeauftragter**
Compliance kompakt
- > **Neue MaRisk - CRD IV - CRR**
Compliance- und Risikocontrolling-Funktion – Whistle-Blowing-System nach §25a KWG neu – Kapitalplanungsprozess – Verrechnungssystem Liquidität
- > **Geldwäsche update**
Neuerungen 2015 – sichere Geldwäscheprävention – Risiko-Workshop
- > **Die 11 anspruchvollsten Teamsituationen**
So bringen Sie Ihr Team in Top-Form

Antwortfax

+49 89 452 429 70 299

Treasury – Management mit LCR und NSFR

Seminarpreis: 690,- € zzgl. 19 % MwSt.

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"/> 11.05.2016 | Frankfurt | <input type="checkbox"/> Bitte senden Sie mir unverbindlich eine Übersicht zu den S&P Tools zu. |
| <input type="checkbox"/> 13.09.2016 | München | <input type="checkbox"/> Nein, ich kann leider nicht teilnehmen. Bitte informieren Sie mich über weitere Veranstaltungstermine |
| <input type="checkbox"/> 03.11.2016 | Frankfurt | <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.
(Versand der Unterlagen erfolgt nach Eingang der Zahlung und Stattfinden des ersten Seminartages). |

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