

INTERNAL LIQUIDITY ADEQUACY ASSESSMENT PROCESS – ILAAP

SÄULE II-ANFORDERUNGEN AN DIE LIQUIDITÄT UND DIE INTERNE UMSETZUNG

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Die Bedeutung der Liquidität hat stark zugenommen, sie hat sich von einer Nebenbedingung zu einer wesentlichen Steuerungsgröße mit bankweiten Implikationen entwickelt. Der Säule-II-Rahmen für aufsichtliche Prüfungen des internen Risikomanagements durch die SREP-Guidelines der EBA und der EZB ist enger und hat einen strengeren Bezug zu den Meldekennzahlen.</p> <p>Im Seminar werden Vorgaben und Herausforderungen an eine angemessene Liquiditätssteuerung, Wirkungszusammenhänge und Rückkopplungseffekte im Management des Liquiditätsrisikos vorgestellt.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ☰ Anforderungen der EBA-Guidelines an die Liquidität <ul style="list-style-type: none"> ● Überblick über die Regelungen ● Umfang der Prüfungsfelder für das Liquiditätsrisiko und das Refinanzierungsrisiko ● Anforderungen an die Modellierung von Cashflows und Liquiditätsreserve ☰ ILAAP-Guidelines der EZB <ul style="list-style-type: none"> ● Überblick über die Grundsätze ● Fokusthema: Ökonomische und normative Perspektive ☰ Überblick über weitere Anforderungen an Strategien, Notfallpläne und Dokumentationsanforderungen wie beispielsweise EBA/GL/2016/10 für das bankinterne „liquidity and funding risk management framework“ ☰ Liquiditätsanforderungen aus der delegierten Verordnung für die LCR und die Additional Liquidity Monitoring Metrics (ALMM) ☰ Integrierte Betrachtung interner und regulatorischer Anforderungen <ul style="list-style-type: none"> ● Aufbau einer Liquiditätsablaufbilanz als Steuerungsinstrument, Aufzeigen von Unterschieden zwischen der Modellierung für die interne und die regulatorische Liquiditätssteuerung ● Anforderungen an die Durchführung von Simulationsrechnungen ● Unterschiedliche Definition der Liquiditätsreserve in Säule I und II, Diskussion über die Eignung der LCR für die Steuerung ● Einbindung der LCR-Elemente und der ALMM-Anforderungen in die Gesamtbanksteuerung, die internen Stressszenarien, die Konzentrationsrisikoanalysen sowie die Strategie 	<p>KATEGORIE Aufsichtsrecht</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER A_12</p> <hr/> <p>SPEZIALISIERUNG</p> <p>Als Spezialisierung können Aspekte der Modellierung und der Risikomessung angeboten werden. Vergleichen Sie dazu unsere weiteren Seminare im Kontext der Liquiditätsrisiken.</p>