

LIQUIDITÄTSRISIKO – MODELLIERUNG UND PRICING

METHODEN FÜR DIE CASHFLOWABLEITUNG WICHTIGER PRODUKTE

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Mit diesem Seminar wird ein Überblick über die Modellierung der liquiditätsrisiko-relevanten Zahlungsströme aller wichtigen Produkte vermittelt. Diese sind Ausgangsbasis für den Aufbau einer Liquiditätsablaufbilanz, der Risikomessung und der Bepreisung.</p> <p>Ein weiteres Ziel der Veranstaltung ist die Vorstellung und Diskussion eines Transferpreissystems für Liquidität.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ☰ Grundlegende Klassifizierung von Cashflows <ul style="list-style-type: none"> ● Modellierungsvorarbeiten ● Abgrenzung stochastischer und deterministischer Zahlungsströme ● Beispiele für typische Produkte ☰ Cash-Flow-Modellierung <ul style="list-style-type: none"> ● Vereinfachter Liquiditäts-Assetklassen-Ansatz vs. produktspezifische Modellierung ● Wertpapiere ● Kredite, Zusagen und Linien ● Spareinlagen (Bodensatzmodell) ● Kündigungsrechte und Derivate ☰ Pricing des Liquiditätsrisikos für einzelne Produkte ☰ Kostenfaktor Liquiditätsrisiko <ul style="list-style-type: none"> ● Komponenten des Liquiditätspreises ● Ermittlung der Kosten für die Liquiditätsbevorratung ● Interne Allokation (Transferpreismodell) 	<p>KATEGORIE Produkte</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER P_09</p>