

LIQUIDITÄTSRISIKOMESSUNG

METHODEN ZUR MESSUNG, KALIBRIERUNG, PRÜFUNG UND VISUALISIERUNG VON LIQUIDITÄTSRISIKEN

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Während der Finanzkrise und den darauf folgenden Jahren ist das Liquiditätsrisiko als wesentliches Bankenrisiko in Erscheinung getreten. Auch die aktuellen MaRisk widmen sich dieser Risikoart immer mehr.</p> <p>Ziel dieses Seminars ist es, einen Überblick über die gebräuchlichen ökonomischen und regulatorischen Modelle und Methoden zur Messung der Liquiditätsrisiken zu erhalten. Deren Kalibrierung, Prüfung und Visualisierung stellen zentrale Themen des Seminars dar.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Finanzmathematische Einführung <ul style="list-style-type: none"> ● Finanzmathematischen Grundlagen ● Allgemeines zum Value-at-Risk ≡ Einteilung und Ableitung der Laufzeitbänder ≡ Grafische Methoden zur Visualisierung des Liquiditätsrisikos <ul style="list-style-type: none"> ● Die Liquiditätsablaufbilanz ● GAP-Analyse ≡ Regulatorische Modelle zur Messung des Liquiditätsrisikos (LCR, ALMM, NSFR) <ul style="list-style-type: none"> ● Regulatorischer Überblick und bevorstehende Neuerung ● Kennzahlensteuerung und -optimierung (LCR, NSFR) ≡ Anforderungen des ILAAP ≡ Quantitative Verfahren zur Messung des Fristentransformationsrisikos <ul style="list-style-type: none"> ● Liquidity Value at Risk ● Praxisbeispiel: Historische Simulation ≡ Quantitative Verfahren zur Messung des Zahlungsunfähigkeitsrisikos <ul style="list-style-type: none"> ● Liquidity at Risk ● Ermittlung des Liquiditätspuffers ≡ Quantitative Verfahren zur Messung des Marktliquiditätsrisikos <ul style="list-style-type: none"> ● Market Liquidity Value at Risk ● Market Impact und Roundtrip ≡ Vorgehensweise beim Backtesting dieser Methoden ≡ Aspekte der Limitierung ≡ Vorschläge zum Reporting von Liquiditätsrisiken 	<p>KATEGORIE Risikomanagement</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER R_07</p>