

# LIQUIDITÄTSRISIKOSTEUERUNG – UNSERE UMSETZUNGSKOMPETENZ

## 1 PLUS i – IHR ERFAHRENER PARTNER

Die Liquiditätsrisikosteuerung ist in den letzten Jahren immer weiter in den Fokus der Gesamtbanksteuerung gerückt.

- 1 PLUS i führt seit vielen Jahren Projekte im Zusammenhang mit Elementen des ILAAP durch.

### Überarbeitung Muster-Risikohandbuch :

- Unterstützung bei der Ausarbeitung der Abschnitte zur Liquiditätstragfähigkeit (LTF)
- Abstimmung der Beschreibungen zur LTF mit den Verbands- und Institutsvertretern

### Liquiditätsrisiko :

- Seit September 2013 betreut 1 PLUS i Aufgaben rund um das Thema Liquiditätsrisiko bei einem Rechenzentrum
- Entwicklung eines institutsübergreifenden Reportingsystems
- Umsetzung ALMM: Überarbeitung der vertraglichen Liquiditätsablaufbilanz
- Ableitung der Liquiditätskennziffern auf Grundlage eines gesamthaften Datenpools

Liquiditätsrisiko – unsere Referenzen

2020

### Liquiditätsaspekte im Zusammenhang mit Stresstests:

- Ausarbeitung des übergreifenden Rahmens für Stresstests inkl. Liquiditätsrisikostresstests in der ökonomischen und normativen Sicht
- Parametrisierung der Liquiditätsrisikostresstests

### Validierung Liquiditätsrisiko:

- Durchführung einer Gap-Analyse für die Bestandsaufnahme
- Neuentwicklung eines Validierungskonzeptes
- Durchführung der Validierung und Übergabe in die Linie
- Erstellung des Validierungsberichtes

Seit 2013

### Funding-Tool:

- Entwicklung eines Tools zur Messung des Refinanzierungsrisikos (Fundingrisiko)
- Umsetzung für verschiedene Produktklassen
- Methodenhandbuch

2012