

Liquiditätsrisikomanagement

Liquiditätsrisiken ordnungsgemäß messen, steuern und melden

DIE THEMEN

- Aktuelle Liquiditätsregulierung und Meldewesen
- Erleichterungen für kleinere Institute
- Stärkung der Resilienz - Handlungsfähigkeit bei Marktturbulenzen sichern
- Liquiditätsrisikosteuerung; Umsetzung und Erfahrungen; Berücksichtigung von Tilgungsoptionen
- Auslegung, Implementierung und Anwendungsbeispiele
- Liquiditätsreserve: Höhe und Fristigkeit

Erfahren Sie,
wie Sie die aktuellen
Liquiditätsanforderungen
erfolgreich umsetzen!

IHRE REFERENTEN



Dr. Engelbert Plassmann
Asset Liability Management,
Group Treasury,
Commerzbank AG,
Frankfurt am Main



Jörg Schäfer
Diplom-Volkswirt,
Experte einer Aufsichtsbehörde,
Frankfurt am Main

Online-Seminar: Liquiditätsrisikomanagement

Ziel des Online-Seminars

Zur internen Bewertung und Steuerung sowie zur aufsichtlichen Überwachung des kurzfristigen Liquiditätsrisikos müssen die Institute die Kennziffern LCR und NSFR sowie den Überwachungs-Parameter AMM implementieren und melden sowie die LCR offenlegen.

Im Online-Seminar erfahren Sie von unseren Experten, welche aktuellen und neuen regulatorischen Anforderungen, Erleichterungen und Nebenbedingungen Sie beachten sollten und wie diese umzusetzen, zu interpretieren und zu melden sind.

Dabei lernen Sie, wie Sie unter Beachtung der regulatorischen Anforderungen Liquiditätsrisiken und -kosten messen, steuern und optimieren können, um so die Rentabilitätssituation Ihres Hauses zu verbessern.

Ihr Nutzen

Am Ende der Schulung sind Sie in der Lage:

- Liquiditätsrisiken zu messen, zu steuern und zu optimieren.
- Die regulatorischen Anforderungen wie LCR, NSFR und AMM korrekt umzusetzen und zu melden.
- Die aktuellen Erleichterungen für kleinere Institute anzuwenden.
- Marktturbulenzen zu analysieren und deren Auswirkungen auf die Liquiditätssteuerung zu verstehen.
- Die Liquiditätsreserve Ihres Instituts in Bezug auf Höhe und Fristigkeit effizient zu managen.

Zusätzlich erhalten Sie ein Zertifikat nach § 15 FAO über 6,5 Zeitstunden!

IHRE REFERENTEN



Dr. Engelbert Plassmann

Asset Liability Management,
Group Treasury, Commerzbank
AG, Frankfurt am Main

Dr. Plassmann ist schwerpunktmäßig für konzeptionelle Fragestellungen zu (Liquiditäts-) Transferpreissystemen und deren projekthafte Umsetzung zuständig. Nach seiner Promotion zu einem ökonomischen Thema war er zunächst im Risikocontrolling der Dresdner Bank mit Stationen im Bereich Risk Methodology Trading tätig.



Jörg Schäfer

Diplom-Volkswirt
Experte einer Aufsichtsbehörde,
Frankfurt am Main

Jörg Schäfer verfügt über langjährige Erfahrung im Bereich Liquiditätsregulierung im Rahmen seiner Tätigkeit bei einer deutschen Aufsichtsbehörde.

Anmerkung: Der Referent vertritt seine persönliche Auffassung und nicht diejenige der Deutschen Bundesbank bzw. der Aufsicht und gibt keine Auslegungen zu regulatorischen Vorgaben ab.

Wer sollte Teilnehmen?

Das Seminar richtet sich an alle, die mit der Umsetzung der Liquiditätsregulierung sowie einer professionellen Messung, Steuerung, Optimierung und Meldung von Liquiditätsrisiken konfrontiert werden.

Ihr Programm im Überblick

Aktuelle Liquiditätsregulierung

Jörg Schäfer

- Regulatorische Vorgaben: LCR, NSFR, AMM
 - Baseler Rahemwerk
 - CRR & Delegierte Verordnung (EU) 2015/61
 - Auslegungen der Europäischen Bankenaufsichtsbehörde
- Liquiditätsmeldewesen unter der CRR II
- ILAAP-Meldewesen
- Komplexität und Proportionalität der Regulierung
- Erleichterungen für kleinere Institute

Liquiditätsrisikosteuerung, Umsetzung und Erfahrungen

Dr. Engelbert Plassmann

- Definition und Messung des Liquiditätsrisikos
- Zusammenhang von LAB und Transferpricing (FTP)
- Abbildung diverser Produkttypen in LAB und FTP
- Höhe und Fristigkeit der Liquiditätsreserve
- Direkte und indirekte Liquiditätskosten
- Abgrenzung von Zins- und Liquiditäts-Transferpricing
- Die Liquiditätsspreadkurve als Steuerungsinstrument
- Liquiditätsspreads und Ausfallrisiko
- Berücksichtigung von Tilgungsoptionen
- Integration regulatorischer Nebenbedingungen

Teilnehmerstimmen

"Gesamteindruck, Unterlagen, technische Betreuung, Organisation und Praxisnutzen waren sehr gut"

"Diskussion von (auch) offenen Fragestellungen"

"Sehr praxisnahe Ausführungen, einschließlich der hier vorhandenen tollen Präsentationsunterlagen"

"Die Inhalte waren sehr umfangreich, es gab breite Einblicke in verschiedene Aspekte des Themengebietes."

Liquiditätsrisikomanagement

ANMELDUNG UNTER

service@forum-institut.de
www.forum-institut.de
Webcode 26 103060

Tel. +49 6221 500-500
Fax +49 6221 500-555



ANMELDEFORMULAR

Ja, ich nehme teil:

Liquiditätsrisikomanagement
Donnerstag, 1. Oktober 2026 - online

Ja, ich bin damit einverstanden, dass das FORUM Institut mir Informationen zu Veranstaltungen
 per E-Mail per Telefon übermitteln darf.
Meine Einwilligung kann ich jederzeit widerrufen.

Name, Vorname

Position/Abteilung

Firma

Straße

PLZ/Ort/Land

Tel./Fax

E-Mail

Ansprechpartner/-in im Sekretariat

Datum, Unterschrift

Termin:

Donnerstag, 1. Oktober 2026 - online
von 09:00 bis 17:00 Uhr

Gebühr:

€ 1.190,00 (+ gesetzl. MwSt.)

Die Gebühr beinhaltet eine Dokumentation und ein Zertifikat nach § 15 FAO über 6,5 Zeitstunden zum Download, den Zugang zum Learning Space sowie technische Betreuung einschließlich PreMeeting.

So funktionieren unsere Online-Veranstaltungen

- Unsere Online-Veranstaltungen finden live und interaktiv im Learning Space statt. Dort finden Sie ebenfalls sämtliche Unterlagen, das Programm und die Liste der Teilnehmenden.
- Zugang zum Learning Space erhalten Sie mit Ihrem Account für das Kundenportal.
- Das Gratis PreMeeting bereitet Sie optimal vor, um eventuelle technische Hürden vorab auszuräumen.
- Eine durchgehende Betreuung während der Online-Veranstaltung garantiert ein optimales Weiterbildungserlebnis.
- Wir garantieren höchste Qualität nach ISO 9001 und ISO 21001.

AGB

Es gelten unsere Allgemeinen Geschäftsbedingungen (Stand: 01.06.2024), die wir auf Wunsch jederzeit übersenden und die im Internet unter www.forum-institut.de/agb eingesehen werden können.

IHR ANSPRECHPARTNER



Robin Reichelt
Konferenzmanager
Financial Services
Tel. +49 6221 500-870
r.reichelt@forum-institut.de

