

Spielräume bei Ausgestaltung des Prozesses der Kapital- und Liquiditätssteuerung unter Beachtung der detaillierten SREP-Leitfäden zum ICAAP und ILAAP!

Kapital- (ICAAP) und Liquiditätsplanung (ILAAP) erfolgreich verzahnen



Vorgaben, Methoden, Fallstricke bei konsistenter Verknüpfung des Steuerungs-, Planungs- und Überwachungsprozesses zur Sicherstellung der Risiko- & Liquiditätstragfähigkeit

10:00 - 13:15 Uhr

Mag. Stefan Millinger

Bereichsleitung Risikomanagement
Bankhaus Carl Spängler & Co.
Aktiengesellschaft

Seit 2015 als Bereichsleiter verantwortlich für Risikomanagement und Gesamtbanksteuerung, u.a. auch für die bankinterne Neuausrichtung der Risikotragfähigkeitskonzepte.

M. Sc. Tim-Oliver Engelke

Spezialist Gesamtbanksteuerung
Controlling und Risikomanagement
Kreissparkasse Düsseldorf

Stv. Leiter der Risikocontrolling-Funktion. Vormalig u.a. Spezialist im Controlling der Sparda-Bank Hessen. Er hat sich u.a. auf Auswirkungen nachhaltiger Finanzwirtschaft auf die Risiko- und Banksteuerung spezialisiert. Autor von Fachpublikationen.

- **Erwartungen der Aufsicht** an bankinterne Verfahren, Methoden und Prozesse zur Beurteilung der Angemessenheit des **Eigenkapitals** und der **Liquidität** – Die „**Sieben Grundsätze**“ im ICAAP- und ILAAP-Leitfaden
- Wichtige **Unterschiede in Grundsätzen** des ICAAP- und ILAAP-Leitfadens trotz hoher Deckungsgleichheit
- Parallelisierung der **Governance-Strukturen** zum ICAAP und ILAAP: **Verknüpfung** der Risikobereitschaft **mit** der Geschäftsstrategie, **Kapital- und Refinanzierungsplanung** • **Aufbau** eines **verzahnten** Strategie-, Kapital- und Refinanzierungs-**Planungsprozesses** auf Basis zeitnaher Informationen
- Auswahl geeigneter **Kennzahlen** zur Steuerung der Risiko- bzw. Liquiditätstragfähigkeit (**Risiko-Reporting**) und Einhaltung der Meldevorgaben (**Aufsicht-Reporting**)
- **Validierungsprozesse** für ICAAP- und ILAAP-Messmethoden • Welche **Kennzahlen** sind zu simulieren? • Erzeugung und **Parametrisierung** neuer Szenarien
- Einbindung des **ICAAP** und **ILAAP** unter Beachtung der **Vermögens-, Ertrags- und Liquiditätslage** – **Verzahnung** der unterschiedlichen Perspektiven in Bezug auf das **Risikoartenuniversum** in der **Risikoinventur**
- **Praxisorientierte** Implementierung eines **LCR-Forecasts** und einer unterjährigen **Eigenmittel-Prognose** der **normativen Perspektive** als Ausdruck des **EZB-Grundsatzes** der Sicherung des **Fortbestandes** • Folgen der **Veränderungen** der **Geschäftstätigkeit** und des wirtschaftlichen **Umfelds**
- Besonderheiten entsprechender **adverser Szenarien** und **Stresstests**: Festlegung des **Risikoappetits** über den **Überlebenshorizont** unterschiedlicher Szenarien • **Höhe des Kapitals** und Größe und Zusammensetzung des **Liquiditätspuffers** auf Basis von **Stresstest-Ergebnissen**

(dazwischen 15 min. Pause)

Mit freundlicher Unterstützung unseres namhaften und etablierten Kooperationspartners:



Kapital- (ICAAP) und Liquiditätsplanung (ILAAP) erfolgreich verzahnen

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

**Kapital- (ICAAP) und Liquiditätsplanung (ILAAP)
erfolgreich verzahnen**



06.07.2023 (230705)

379,00 €*

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	322,15 €
Treue PLUS 20	303,20 €
Treue PLUS 25	284,25 €

Sie interessieren sich für unser TreuePlus-Rabattmodell?
Infos unter <https://fch-gruppe.de/TreueAngebot>

Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen.

Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:
(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Die Verfahren, Methoden und Prozesse zur Beurteilung der Angemessenheit des **Eigenkapitals (ICAAP)** und der **Liquidität (ILAAP)** sind wichtige Bestandteile des internen Risikomanagement, denn sie leisten einen wesentlichen Beitrag zur **Bestimmung** der **Kapital- und Liquiditätsanforderungen im SREP**. Hierbei spielt die Kapital- und Liquiditätsausstattung sowie die **Verzahnung** der **mehrwährigen Kapital- mit der Liquiditätsplanung** eine bedeutsame Rolle. Zwei erfahrene Gesamtbanksteuerer arbeiten zunächst die Bedeutung des **ICAAP- und ILAAP-Leitfadens** sowie deren **Zusammenspiel** für die spätere **SREP-Bewertung** heraus. Im Anschluss geben sie wertvolle **Umsetzungshinweise** für die **Verknüpfung** der Steuerungs-, Planungs- und Überwachungsprozesse (z.B. Abstimmung zwischen Planungshorizonten) zur laufenden **Sicherstellung** der **Risiko- und Liquiditätstragfähigkeit**.

06.07.2023 10:00 bis 13:00 Uhr

Online-Veranstaltung mit Zoom. Zoom ist der erste Anbieter von Videokonferenzlösungen, dessen Software im Jahr 2021 vom BSI nach dem internationalen Standard Common Criteria zertifiziert wurde.

Der Zugang zum Seminar erfolgt über Ihren persönlichen Nutzerbereich in „MeinFCH“. Informationen zum Zugang und eine Anleitung erhalten Sie spätestens eine Woche vor dem Seminar. Ihre Teilnahmebestätigung und die Seminardokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei zeitgleicher Anmeldung einen Rabatt von **20%**.

Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung Ihre Anmeldebestätigung/Rechnung. Bitte überweisen Sie den Rechnungsbetrag innerhalb von 30 Tagen nach Zugang der Rechnung.

Eine Stornierung Ihrer Anmeldung ist nicht möglich. Eine kostenfreie Vertretung durch Ersatzteilnehmer beim gebuchten Termin dagegen schon. Der Name des Ersatzteilnehmers muss dem Veranstalter jedoch spätestens vor Seminarbeginn mitgeteilt werden. Wir weisen darauf hin, dass „Teilnahmen“ von anderen als den gebuchten Teilnehmern nicht gestattet sind und Schadensersatzansprüche des Veranstalters auslösen.

Bei Absage durch den Veranstalter wird das volle Seminarentgelt erstattet. Darüber hinaus bestehen keine Ansprüche. Änderungen des Programms aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

* zzgl. 19 % MwSt. ** inkl. 7 % MwSt. *** zzgl. 7 % MwSt.

Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die Finanz Colloquium Heidelberg GmbH und ihre Dienstleister (z. B. Lettershop) verwenden Ihre personenbezogenen Daten für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen ausgewählte Fach- und Produktinformationen per Post zukommen zu lassen. Sie können der Verwendung Ihrer Daten jederzeit durch eine Mitteilung per Post, E-Mail oder Telefon widersprechen.

Senden Sie mir bitte Fach- und Produktinformationen sowie die Banken-Times SPEZIAL für meinen Fachbereich kostenfrei an meine angegebene E-Mail Adresse (Abbestellung jederzeit möglich).

Senden Sie uns Ihre Bestellung per Mail an:
info@fch-gruppe.de

oder schriftlich an:
Finanz Colloquium Heidelberg GmbH
Im Bosseldorn 30, 69126 Heidelberg
Fax: +49 6221 99898-99

Weitere Informationen erhalten Sie unter:
+49 6221 99898-0
oder unter **www.FCH-Gruppe.de**

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen

Anmelden / Bestellen