

TREASURY UND ASSET LIABILITY MANAGEMENT FÜR DIE GESAMTBANK

DATUM DER NÄCHSTEN VERANSTALTUNG

06.11.2019 bis 07.11.2019

ORT

east Hotel

Simon-von-Utrecht-Straße 31

20359 Hamburg

Deutschland

Phone General: +49.40.30993.0

Fax: +49.40.30993.200

REFERENT

Klaus Leusmann Wilhelm Menninghaus Timo Franke Maik Picker Martin Knippschild

AGENDA

Das Seminar beginnt jeweils um 09:00 Uhr und endet am ersten Seminartag gegen ca. 19:00 Uhr und am zweiten Seminartag gegen ca. 17:00 Uhr.

Pro Veranstaltungstag sind zwei Kaffeepausen (vor- und nachmittags) sowie ein Mittagessen geplant.

Etwas Programmänderungen aus dringendem Anlass bleiben vorbehalten.

Mittwoch, 6. November 2019 - 9:00 bis 9:45

Treasury als zentrale Erfolgsquelle für die Gesamtbank/Ausgestaltung einer integrierten Treasury-Steuerung

Einordnung und Abgrenzung des Treasury-Begriffs | Treasury-Konzeption und Verantwortungsbereiche | Zielgrößen, Ergebnisbereiche und Methoden im Rahmen der Treasury-Steuerung | Vermögensorientierte versus GuV-orientierte Konzepte | Alternative Steuerungsstrategien | Ergebnisbeiträge aus Fristentransformation | Aktuelle Fragestellungen

Mittwoch, 6. November 2019 - 9:45 bis 10:30

Regulatorisches Update zur Steuerung des IRRBB und der Liquidität inkl. Eigenkapitalanforderungen (EBA/BCBS/BaFin/CRD V)

Aktuelle aufsichtsrechtliche Anforderungen und Umsetzungsstand | Liquiditätskennzahlen LCR/NSFR | EBA-Leitlinien zur Messung und Steuerung des IRRBB | BCBS-Grundsätze für das Management des Zinsrisikos nach Säule 2 | Kapitalanforderungen für Zinsänderungsrisiken durch SREP-Kapitalzuschlag/Allgemeinverfügung | Neufassung BaFin-Rundschreiben zum Standardzinsschock

Mittwoch, 6. November 2019 - 11:00 bis 12:30

Steuerungsimpulse barwertiger und periodischer Zielgrößen für das Treasury

Messung der Ergebnisse aus der Fristentransformationssteuerung | Zusammenhang und Überleitung barwertiger und periodischer Ergebnisbeiträge | Vorteile und Grenzen barwertig orientierter Steuerungssysteme | Voraussetzungen und Anforderungen an GuV-orientierte Steuerungssysteme

Mittwoch, 6. November 2019 - 13:30 bis 15:00

Dreiteilige Praxisfallstudie - Integrierte Steuerung des gesamtbankbezogenen Zinsbuchs:

Generierung des Gesamtbankcashflows und strukturelle Analyse des Zinsbuchs (Teil I)

Überblick der Kernprozesse einer integrierten Zinsbuchsteuerung | Vorgehen bei der Cashflowgenerierung in der Praxis | Strukturanalyse und Bewertung von Cashflows | Abbildung variabler Produkte aus Zinsrisiko- und Liquiditätsperspektive | Bedeutung und Einbezug impliziter Optionen im Kundengeschäft | Ermittlung Zinsbuchbarwert und Reserven im Zinsbuch

Mittwoch, 6. November 2019 - 15:30 bis 17:00

Beurteilung von Performance und Risikostatus des Zinsbuchs aus der barwertigen Perspektive (Teil II)

Simulation von Zinsszenarien und Analyse der Performance | VaR-Modelle zur Risikoquantifizierung | Bedeutung der regulatorischen Anforderungen | Hedge-Wirkung des variablen Geschäfts | Ertragspotenziale aus Fristentransformation | Bewertung des Risk-Return-Profiles von Zinsbuch und alternativen Benchmarks

Mittwoch, 6. November 2019 - 17:30 bis 19:00

Kamingespräch/Praxisvortrag: Treasury-Management und Risikocontrolling aus der Perspektive einer Großbank

Diskussion aktueller Herausforderungen: IFRS, Basel III/IV, Liquiditätsrisiken, Stresstesting, IRRBB und Kapitalmanagement

Donnerstag, 7. November 2019 - 9:00 bis 10:30

Dynamische GuV-Simulation und Planung des Zinsergebnisses - Identifikation der adäquaten Treasury-Strategie (Teil III)

Periodische Planung der Erfolgsquellen und Zinsergebnissimulation | Analyse der GuV-Risiken und Potenziale aus der Fristentransformation | Strukturbeiträge als "natürlicher Hedge" des Geschäftsmodells | Bestimmung des "optimalen Zinsbuchhebels" | Verzahnung von barwertiger und GuV-orientierter Steuerung des Zinsbuchs zur Strategieableitung

Donnerstag, 7. November 2019 - 11:00 bis 12:30

Fixierung der Steuerungsstrategie und Auswahl geeigneter Benchmarks

Alternative Steuerungsstrategien - Trading versus Benchmarking | Strategische Umsetzungsoptionen in der Praxis | Ertragschancen und Risiken einer strategischen Fristentransformation | Kompensationswirkungen zwischen Vertrieb und Treasury - Impulse für die Strategie | Ableitung von Steuerungsmaßnahmen im Kontext einer aktiven oder passiven Strategie

Donnerstag, 7. November 2019 - 13:30 bis 14:30

Fallstudie: Gesamtbankbezogene Strukturbeitragsbilanz - Identifikation der Erfolgsquellen des Zinsergebnisses

Aufbau einer Strukturbeitragsbilanz | Integration unverzinslicher Positionen und Eigenkapital | Vorgehen zur Abbildung der Eigengeschäfte | Ausweis der Bestandteile des Treasury-Ergebnisses | Optimierung der Steuerung in den Schnittstellen von Treasury/Vertrieb | Grundprinzip des dynamischen Replikationsmodells | Austausch von Praxiserfahrungen zur Auswahl der "richtigen" Steuerungsansätze | Trennung von Zinsfristen- und Liquiditätsfristentransformation

Donnerstag, 7. November 2019 - 15:00 bis 16:15

Steuerung des Liquiditätsrisikos und Optimierung Funding-Mix

Strukturelles versus dispositives Liquiditätsrisiko | Liquiditätsablaufbilanzen | Ausgestaltung und Struktur Liquiditätspuffer (HQLA) | Funding und Strukturierung der Refinanzierungsseite | Messung Liquiditätsrisiko und Stresstesting | Aufsichtliche Kennzahlen LCR/NSFR | Bestimmung und Verrechnung von steuerungsadäquaten Liquiditätskosten

Donnerstag, 7. November 2019 - 16:15 bis 17:00

Governance, Zielbild und organisatorische Verankerung des Treasury

Verantwortlichkeiten und Aufgaben im Überblick | Aufbauorganisatorische Verankerung des Treasury | Rolle und

Selbstverständnis des Treasury | Governance-Funktion für die Steuerung der Gesamtbank | Verantwortungen in übergreifenden Steuerungsprozessen | Führung von Treasury als Profitcenter/eigenes Geschäftsfeld oder als Dienstleister für die Gesamtbank | Ausgestaltung "Zielbild Treasury" - Vor- und Nachteile alternativer Umsetzungsmodelle in der Praxis