

LIQUIDITÄTSMANAGEMENT

UNTER BASEL III/CRD IV

Praktische Umsetzung der neuen Regelungen:

- Mindest- und Meldestandards: LCR, NSFR, Beobachtungskennziffern
- Transferpricing nach der neuen Regulierung
- Optimierungsansatz zur Verbesserung der LCR/NSFR und P&L
- LCR Steuerung vs. Asset Allocation
- Asset-Based Funding

Ihre Experten



Dr. Silvio Andrae,
DSGV



Stephan Bellarz,
DZ Bank



Jochen Deiss,
RLB Steiermark



Josef Gruber,
Bayern LB



Peter Heumüller,
Nord LB



Dr. Bernd Hochberger,
Stadtsparkasse München



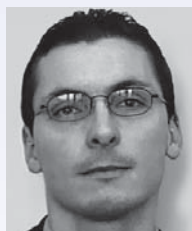
Jens Holstein,
Naussauische Sparkasse



Isabel Mailly,
BaFin/EBA



Torsten Probst,
WL Bank Münster



Jörg Schäfer,
Deutsche Bundesbank



Markus Schulz,
Commerzbank



André Weidemeier,
TXS

In Kooperation mit



IFF
International Faculty of Finance

„Banker hadern mit Liquiditätsregeln“

(Börsen-Zeitung, 18.8.12)

„Zum Teil noch erheblicher Handlungsbedarf“

(diebank 9.2012)

Das Liquiditätsmanagement steht unter Druck: Durch diverse Regulierungsvorhaben haben Banken eine Vielzahl von Anforderungen zu erfüllen, die bestehende Geschäftsmodelle und die Fristentransformation in Frage stellen.

Offiziell läuft noch die Beobachtungsphase, de facto muss bereits jetzt gehandelt werden.

Dabei ist im Detail immer noch nicht klar, wie genau die Umsetzung der Vorgaben und Meldungen erfolgen soll.

Informieren Sie sich jetzt aus erster Hand!

- Vertreter der EBA-Subgroup und der Bundesbank erläutern neue Anforderungen und Prüfungspraxis.
- Praktiker aus Großbanken und Regionalinstituten erörtern die Konsequenzen für Liquiditätssteuerung, Transferpricing und Funding.
- Am zweiten, separat buchbaren, Praxistag steht die konkrete Umsetzung im Bilanzmanagement, Meldewesen und IT im Mittelpunkt.

Nutzen Sie jetzt die Gelegenheit, die Umsetzung der neuen Regularien einen entscheidenden Schritt weiterzubringen.

Für wen ist diese Konferenz konzipiert?

Führungs- und Fachkräfte aus den Bereichen

- Liquiditätsmanagement
- Treasury, Funding
- Asset Liability Management
- Meldewesen, Aufsicht
- Risikocontrolling
- Gesamtbanksteuerung
- Revision

Angesprochen sind sowohl Kreditinstitute des öffentlich-rechtlichen sowie genossenschaftlichen Sektors als auch kapitalmarktfinanzierte Geschäftsbanken.

Des Weiteren richtet sich die Veranstaltung an Unternehmensberater sowie Rechtsanwälte, die sich mit dem Liquiditätsmanagement in Kreditinstituten beschäftigen.

Konferenz

Dienstag, 9. April 2013

9.00 – 9.30

Empfang mit Kaffee und Tee,
Ausgabe der Tagungsunterlagen

9.30 – 9.45

Begrüßung und Eröffnung der Konferenz durch den Vorsitzenden
Dr. Roland Erben, Chefredakteur, RISIKO MANAGER

Anforderungen aus Sicht der Aufsicht und Revision

Aufsicht

9.45 – 10.30

Neue internationale Liquiditätsstandards

- ▶ Neuer Rechts-/Regulierungsrahmen unter Basel III/CRD IV
- ▶ Mindest- und Meldestandards (LCR, NSFR, Beobachtungskennziffern)
- ▶ Fragen der nationalen Umsetzung
- ▶ Baseler Kennziffernkatalog zum untertägigen Liquiditätsmanagement
- ▶ Ausblick: Weitere Arbeiten des Baseler Ausschusses bzw. auf europäischer Ebene

Jörg Schäfer, Bereich „Internationale Eigenkapital- und Liquiditätsregelungen“ der Abteilung „Bankenaufsichtsrecht und internationale Bankenaufsicht“, Deutsche Bundesbank sowie Mitglied der „Working Group on Liquidity“ des Baseler Ausschusses

Aufsicht

10.30 – 11.15

EBA: Berichte, Standards und Leitlinien zu Liquidität

- ▶ Durchführungsstandard zum Europäischen Meldewesen
- ▶ Einheitliche Definition der liquiden Aktiva
- ▶ Grenzüberschreitende Intragruppenströme
- ▶ Leitlinien zu Abflüssen aus Retaileinlagen
- ▶ Regulierungsstandard zu Nachschusspflichten aus besicherten Transaktionen

Isabel Mailly, EBA Subgroup on Liquidity, Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin), Bankenaufsicht, Grundsatzabteilung Liquiditätsrisiko

Zeit für Ihre Fragen und Diskussion [11.15 – 11.35]

Pause mit Kaffee und Tee [11.35 – 12.00]

12.00 – 12.45

Prüfung von Liquiditätsrisiken aus Sicht der internen Revision

- ▶ Auswirkungen der neuen Standards auf die Revision
- ▶ Herleitung eines risikoorientierten Prüfungsansatzes
- ▶ Prüfung des internen Liquiditätsrisikomodells der DZ BANK

Stephan Bellarz, Abteilungsleiter Revision Bank- und Risikosteuerung, DZ Bank AG

Zeit für Ihre Fragen und Diskussion [12.45 – 13.00]

Gemeinsames Mittagessen [13.00 – 14.30]



Dr. Roland Erben



Jörg Schäfer



Isabel Mailly



Stephan Bellarz



Josef Gruber



Konsequenzen für Liquiditätsstrategie, Transferpricing und Funding

14.30 – 15.15

Treasury und Liquiditätsmanagement in der Praxis – aktuelle Herausforderungen für die Zukunft

- ▶ Transferpricing im Zuge von LCR und NSFR
- ▶ Auswirkung von Basel III auf die Bankbuchsteuerung
- ▶ Zunehmende Bedeutung des Fundingmix
- ▶ Treasury im Wandel – ein kurzer Ausblick

Josef Gruber, Bereichsleiter Group Treasury, Bayern LB

15.15 – 16.00

Liquiditätsrisikomanagement in der Gesamtbanksteuerung

- ▶ Motivation der neuen Liquiditätsregulierung
- ▶ Zusammenspiel mit der Gesamtbanksteuerung
- ▶ Auswirkungen auf das interne Funds Transfer Pricing
- ▶ Implikationen der Liquiditätsregeln auf die Geschäftsstrategie

Markus Schulz, Head of Conceptual Liquidity Management Support, Group Treasury, Commerzbank AG

Zeit für Ihre Fragen und Diskussion [16.00 – 16.15]

Pause mit Kaffee und Tee [16.15 – 16.45]

16.45 – 17.30

Liquiditätsstrategien aus Sicht einer Sparkasse

- ▶ Optimierungsansatz zur Verbesserung der LCR/NSFR und P&L: Fallbeispiel
- ▶ LCR Steuerung vs. Asset Allocation
- ▶ Produktanpassungen

Dr. Silvio Andrae, Referent Bankaufsichtliches Risikomanagement / Abt. C IV Controlling, Deutscher Sparkassen- und Giroverband (DSGV)

17.30 – 18.00

PANEL-DISKUSSION



Liquiditätssteuerung zwischen Überregulierung, komplexen Risiken und steigenden Kosten: Wie sieht die Zukunft des Treasury aus?

Diskutieren Sie mit den Referenten des Nachmittags Ihre Fragen!

Abschlussdiskussion, Zusammenfassung und Ende des Konferenztages [18.00]



Im Anschluss an den Konferenztag lädt EUROFORUM Sie herzlich zu einem gemeinsamen Umtrunk ein. Nutzen Sie die Gelegenheit zu einem informellen Erfahrungsaustausch und lassen Sie den Tag Revue passieren.

+ Praxistag

Mittwoch, 10. April 2013

8.30 – 9.00

Empfang mit Kaffee und Tee

9.00 – 9.30

Begrüßung und Eröffnung des Praxistages durch den Vorsitzenden

Prof. Dr. Stefan Zeranski, Brunswick European Law School

Liquiditätsmanagement in der Praxis: Steuerung, Controlling, Meldewesen

9.30 – 10.15

Geschäftspolitische Konsequenzen aus der Umsetzung der neuen Liquiditätsanforderungen unter Basel III

- ▶ Herausforderungen in der Liquiditätssteuerung
- ▶ Ziele der Refinanzierungsstrategie
- ▶ Umsetzung und Praxisbeispiele

Dr. Bernd Hochberger, Treasury Vorstand, Stadtparkasse München

10.15 – 11.00

Aspekte der LCR-Steuerung

- ▶ Komplexität als Herausforderung
 - ▶ LCR-Cockpit – Simulation und Optimierung in der Praxis
- Peter Heumüller, Leiter Finance, Norddeutsche Landesbank, Luxemburg

Ihre Fragen und Diskussion [11.00 – 11.30]

Pause mit Kaffee und Tee [11.30 – 12.00]

12.00 – 12.30

Risikosteuerungs- und controllingprozess von Liquiditätsrisiken in der Praxis

- ▶ Stufen des Liquiditätsmanagements
- ▶ Implikationen aus LCR und NSFR
- ▶ Szenarien und Stresstests

Jens Holstein, Projektleiter Basel III, Zentralbereich Gesamtbanksteuerung, Nassauische Sparkasse, Lehrbeauftragter für Bankrecht und Bankregulierung an der Hochschule Rhein Main

Ihre Fragen und Diskussion [12.30 – 12.45]

Gemeinsames Mittagessen [12.45 – 14.00]



Dr. Silvio Andrae



Prof. Dr. Stefan Zeranski



Dr. Bernd Hochberger



Peter Heumüller



Jens Holstein



André Weidemeier

14.00 - 14.45

Asset-Based Funding – Strategien und Umsetzungsbeispiele

- ▶ Liquiditätsrisiko im Kontext der Banken- und Eurokrise
- ▶ Collateral Allocation Management als zentrales Werkzeug der Bankensteuerung
- ▶ Herausforderungen bei der Integration eines Collateral Allocation Managements

André Weidemeier, Asset-Based Funding, TXS GmbH

Jochen Deiss, Treasurer, Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG

14.45 - 15.30

Liquiditätskennzahlen: Steuerung und Meldewesen: Praktische Umsetzung

- ▶ Ausgangslage
- ▶ Einflüsse auf die Steuerung
- ▶ Umsetzung im Trilog
(Treasury/Risikomanagement/Meldewesen)
- ▶ Ausblick

Volker Liermann, Partner, ifb group

Torsten Probst, Referatsleiter Short-Term & Credit, WL Bank Münster

Abschlussdiskussion [15.30 - 16.00]

Ende des Praxistages [16.00]



Jochen Deiss



Volker Liermann



Torsten Probst

3 gute Gründe für den Besuch von Konferenz und Praxistag

- 1 Sie treffen Vertreter von EBA und Bundesbank, die Ihnen die neuen Anforderungen und Prüfungspraxis aus erster Hand erläutern
- 2 Sie diskutieren mit Praktikern aus Großbanken und Regionalinstituten die konkrete Steuerung in der Praxis
- 3 Sie haben die Möglichkeit, sich mit Fachkollegen auszutauschen und über den Tellerrand zu schauen

Teilnehmerstimmen 2012

„Guter Überblick über die Liquiditätssteuerung in der deutschen Banklandschaft“

Thomas Dürrnagel, Wüstenrot Bausparkasse

„Hohe Praxisnähe!“

Christian Weinzierl, Bankhaus Donner und Reuschel

Infoline: +49 (0) 2 11/96 86 – 34 63

Haben Sie Fragen zu dieser Veranstaltung?

Wir helfen Ihnen gerne weiter.

Konzeption und Inhalt:

Carola Bergmann (Senior-Konferenz-Managerin)

Organisation:

Friederike Hintze (Konferenz-Koordinatorin)

E-Mail: friederike.hintze@euroforum.com

Sponsoring und Ausstellungen

Im Rahmen der Veranstaltung besteht die Möglichkeit, dem exklusiven Teilnehmerkreis Ihr Unternehmen und Ihre Produkte oder Dienstleistungen zu präsentieren. Ihre Fragen zu Sponsoring- und Ausstellungsmöglichkeiten sowie zur Zielgruppe beantwortet Ihnen gerne:

Niklas-Fabian Kater (Senior-Sales-Manager)

Telefon: +49 (0) 2 11/96 86 – 37 16

Fax: +49 (0) 2 11/96 86 – 47 16

E-Mail: fabian.kater@euroforum.com



www.euroforum.de/liquiditaet

[Kenn-Nummer]

schriftlich: EUROFORUM Deutschland SE
Postfach 11 12 34, 40512 Düsseldorf
anmeldung@euroforum.com
per E-Mail: anmeldung@euroforum.com
per Fax: +49 (0)2 11/96 86-40 40
telefonisch: +49 (0)2 11/96 86-34 63 [Friederike Hintze]
im Internet: www.euroforum.de/liquiditaet

Teilnahmebedingungen. Der Teilnahmebetrag für diese Veranstaltung inklusive Tagungsunterlagen, Mittagessen und Pausengetränken pro Person zzgl. MwSt. ist nach Erhalt der Rechnung fällig. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Bestätigung. Die Stornierung (nur schriftlich) ist bis 14 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenlos möglich, danach wird die Hälfte des Teilnahmebetrages erhoben. Bei Nichterscheinen oder Stornierung am Veranstaltungstag wird der gesamte Teilnahmebetrag fällig. Gerne akzeptieren wir ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer. Programmänderungen aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

Datenschutzinformation. Die EUROFORUM Deutschland SE verwendet die im Rahmen der Bestellung und Nutzung unseres Angebotes erhobenen Daten in den geltenden rechtlichen Grenzen zum Zweck der Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen postalisch Informationen über weitere Angebote von uns sowie unseren Partner- oder Konzernunternehmen zukommen zu lassen. Wenn Sie unser Kunde sind, informieren wir Sie außerdem in den geltenden rechtlichen Grenzen per E-Mail über unsere Angebote, die den vorher von Ihnen genutzten Leistungen ähnlich sind. Soweit im Rahmen der Verwendung der Daten eine Übermittlung in Länder ohne angemessenes Datenschutzniveau erfolgt, schaffen wir ausreichende Garantien zum Schutz der Daten. Außerdem verwenden wir Ihre Daten, soweit Sie uns hierfür eine Einwilligung erteilt haben. Sie können der Nutzung Ihrer Daten für Zwecke der Werbung oder der Ansprache per E-Mail oder Telefax jederzeit gegenüber der EUROFORUM Deutschland SE, Postfach 11 12 34, 40512 Düsseldorf widersprechen.

Zimmerreservierung. Im Tagungshotel steht Ihnen ein begrenztes Zimmerkontingent zum ermäßigten Preis zur Verfügung. **Bitte nehmen Sie die Zimmerreservierung direkt im Hotel unter dem Stichwort „EUROFORUM-Veranstaltung“ vor.**

Ihr Tagungshotel.

Am Abend des ersten Veranstaltungstages lädt Sie das Hotel Savigny MGallery herzlich zu einem Umtrunk ein.



EUROFORUM-Konferenz

LIQUIDITÄTSMANAGEMENT

UNTER BASEL III/CRD IV

Separat
buchbarer
Praxistag!

Praktische Umsetzung von: LCR und NSFR –
Auswirkungen auf Steuerung, Transfer Pricing, Funding und Meldewesen

9. und 10. April 2013, Hotel Savigny Frankfurt City MGallery

Savignystraße 14-16, 60325 Frankfurt/Main, Telefon: +(0)69/75 33-0



Bitte ausfüllen und faxen an: +49 (0) 2 11/96 86-40 40

- Ja, ich nehme am 9. und 10. April 2013 (Konferenz und Praxistag) teil
zum Preis von € 2.049,- p.P. zzgl. MwSt. [P1105941M012]
- Ja, ich nehme am 9. April 2013 (Konferenz) teil
zum Preis von € 1.599,- p.P. zzgl. MwSt. [P1105941M100]
- Ja, ich nehme am 10. April 2013 (Praxistag) teil
zum Preis von € 1.499,- p.P. zzgl. MwSt. [P1105941M200]
[Ich kann jederzeit ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer benennen.
Im Preis sind ausführliche Tagungsunterlagen enthalten.]
- Ich kann nicht teilnehmen. Senden Sie mir bitte die **Tagungsunterlagen** zum
Preis von € 399,- zzgl. MwSt.
[Lieferbar ab ca. 2 Wochen nach der Veranstaltung.]
- Ich interessiere mich für **Ausstellungs- und Sponsoringmöglichkeiten.**
- Ja, ich abonniere den monatlichen E-Mail-Newsletter
mit den aktuellen Veranstaltungsterminen zu Bankenthemen. [SIWA01]
- Ja, ich abonniere den Katalog Finanzwissen mit den
aktuellen Seminarterminen. [R05183]
- Ich möchte **meine Adresse wie angegeben korrigieren** lassen.
[Wir nehmen Ihre Adressänderung auch gerne telefonisch auf: +49 (0)2 11/96 86-33 33.]

| | |
|---|-----|
| Name | |
| Position/Abteilung | |
| Telefon | Fax |
| E-Mail | |
| Die EUROFORUM Deutschland SE darf mich über verschiedenste Angebote von sich, Konzern- und Partnerunternehmen wie folgt zu Werbezwecken informieren: Zusendung per E-Mail: <input type="radio"/> Ja <input type="radio"/> Nein Zusendung per Fax: <input type="radio"/> Ja <input type="radio"/> Nein | |
| Firma | |
| Anschrift | |
| Branche | |
| Ansprechpartner im Sekretariat | |
| Datum, Unterschrift | |