

Das müssen Sie jetzt wissen!

Liquiditäts-Treasury

So haben Sie auch in turbulenten Zeiten Ihre Liquiditätsrisiken jederzeit im Griff und garantieren eine optimale Liquiditätssteuerung!

Alles, was Sie zu den Instrumenten und Maßnahmen wissen müssen!

Die Seminarinhalte werden top-aktuell aufbereitet!

- Liquiditätsrisiken korrekt messen, adäquat abbilden und sinnvoll limitieren
- Liquidität kurz-, mittel- und langfristig perfekt steuern
- Stochastische Cashflows sachgerecht modellieren
- Richtige Steuerungsimpulse für eine Ertragssteigerung setzen
- Stresstests und Notfallszenarien strukturiert durchführen
- Liquidity at Risk in der ertragsorientierten Banksteuerung optimal anwenden
- Refinanzierungsstrategien nachhaltig verbessern
- Auf aufsichtliche Prüfungen perfekt vorbereitet sein

2. Modul unserer Zertifizierungs-Reihe „Der Treasury Manager in Banken“

Ihr Seminarleiter:



Dr. Peter Bartetzky
TriSolutions GmbH

Ihre Referenten:

Dr. Günter Fiebach
Deutsche Postbank AG

Stefan Rehsmann
Deutsche Bundesbank

Dr. Holger Thomae
TriSolutions GmbH

Sven Wirth
Deutsche Bundesbank

Dr. Stefan Zeranski
Kölner Bank eG

Diskutieren Sie mit den Experten:

- ✓ Welche Lehren können aus der Finanzmarktkrise gezogen werden?
- ✓ Welche aufsichtsrechtlichen Anforderungen kommen 2009 auf Sie zu?

Hoher Lernerfolg durch begrenzte Teilnehmerzahl!

Bitte wählen Sie Ihren Termin:
27. und 28. April 2009 in Frankfurt/M.
15. und 16. Juni 2009 in München



Special:

Jeder Teilnehmer erhält das „Handbuch Liquiditätsrisiko“!

MANAGEMENTCIRCLE®
BILDUNG FÜR DIE BESTEN

Melden Sie sich jetzt an! Telefon-Hotline: 0 61 96/47 22-700

So erfüllen Sie die aktuellen Anforderungen an Ihr Liquiditätsrisiko-Management und haben Ihre Liquiditätsrisiken jederzeit im Griff!

Ihr Seminarleiter:
Dr. Peter Bartetzky, Geschäftsführer, **TriSolutions GmbH**, Hamburg

Empfang mit Kaffee und Tee, Ausgabe der Seminarunterlagen **ab 9.15 Uhr**

10.00 Herzlich Willkommen!

- Begrüßung durch den Seminarleiter
- Darstellung der Inhalte und Zielsetzung des Seminars
- Abgleich mit Ihren Erwartungen als Teilnehmer

10.15 Liquidität, Liquiditätsrisiko, Liquiditätsrisiko-Management – Das müssen Sie jetzt wissen!

- Die verschiedenen Dimensionen der Liquidität
- Best Practice-Definition des Liquiditätsrisikos
- Unterschiede und Gemeinsamkeiten zu anderen Risikoarten
- Marktzinsmethode als Voraussetzung für ein modernes Treasury
- Bestimmung der risikoadäquaten Einstandssätze
- Trennung zwischen Zins- und Liquiditätsrisiko-Management
- Beispiel aus der Praxis
- Aktuelle aufsichtsrechtliche Entwicklungen

Dr. Peter Bartetzky

11.30 Kaffee- und Teepause

12.00 Aktuelle Anforderungen an das Liquiditätsrisiko-Controlling

- Funds Transfer Pricing für das Liquiditätsrisiko
- Modellierung der stochastischen Cashflows
- Sachgerechter Aufbau der Liquiditätsablaufbilanz
- Korrekte Ermittlung der P&L für das Liquiditätsrisiko
- Liquidity at Risk vs. Liquidity Value at Risk
- Methoden und Maßnahmen zur Limitierung des Liquiditätsrisikos
- Strukturiertes Stress Testing
- Aktuelle und künftige nationale und internationale Standards

Dr. Peter Bartetzky

13.15 Gemeinsames Mittagessen

14.30 Integriertes Liquiditätsrisiko-Management in der Praxis und sinnvolle Refinanzierungsstrategien

- Sicherstellung einer ausgewogenen Funding-Politik
- Sinnvolle Refinanzierungsalternativen: Darstellung unterschiedlicher Wege und Diskussion der Vor- und Nachteile
- Sinnvolle geschäftspolitische Maßnahmen und Setzen der richtigen Steuerungsimpulse auch in „Krisenzeiten“
- Ertragspotenziale aus der Liquiditätsfristentransformation effizient nutzen
- Die zentralen Schlüsselemente für eine erfolgreiche Bewältigung von „Notfällen“

Dr. Peter Bartetzky

16.00 Kaffee- und Teepause

16.30 Die aufsichtliche Zulassung bankinterner Liquiditätsrisikomess- und -steuerungsverfahren nach § 10 LiqV

- Regulatorischer Kontext
- MaRisk und LiqV als Säulen der Liquiditätsrisikoaufsicht
- Öffnungsklausel der LiqV (§ 10)
- Prüfungs- und Genehmigungsprozess für bankinterne Liquiditätsmodelle
- Vorbereitungen der Aufsicht zur Durchführung der Prüfungen nach § 10 LiqV
– Merkblatt sowie Bundesbank-/BaFin-Studie „Praxis des Liquiditätsrisikomanagements“

Stefan Rehmann
Zentralbereich Banken- und Finanzaufsicht,
Deutsche Bundesbank, Frankfurt/M.
am 27. April 2009 in Frankfurt/M.

Sven Wirth
Zentralbereich Banken- und Finanzaufsicht,
Deutsche Bundesbank, Frankfurt/M.
am 15. Juni 2009 in München

17.45 Zusammenfassung der Ergebnisse des Tages und Gelegenheit zur Diskussion

18.00 Ende des ersten Seminartages und Get-Together



Get-Together

Ausklang des ersten Seminartages in informeller Runde. **Management Circle** lädt Sie zu einem kommunikativen Umtrunk ein. Entspannen Sie sich in angenehmer Atmosphäre und vertiefen Sie Ihre Gespräche mit den Referenten und Teilnehmern!

So gewährleisten Sie eine effiziente Liquiditätssteuerung und behalten auch in „Notfällen“ den Überblick!

Ihr Seminarleiter:
Dr. Peter Bartetzky

9.00 Es geht weiter! Begrüßung und Überleitung zum zweiten Seminartag

Liquiditätsrisiken sicher bewerten und managen: bewährte Methoden und Instrumente

- Besonderheiten des Assets Liquidität
- Liquiditätsbedarfsprognose erstellen
- Refinanzierungsstrategie optimieren
- Liquiditätsrisikokosten sicher bemessen
- Liquiditätsrisiken praktisch abbilden
- Spezialfälle und Besonderheiten
- Lambda, der letzte Grieche...
- Sichere Analyse historischer Stress-Szenarien
- Umsetzung von Stress-Szenarien in der Praxis

Dr. Holger Thomae

Partner,

TriSolutions GmbH, Hamburg

10.30 Kaffee- und Teepause

11.00 Kurzfristige Liquiditätssteuerung in der Praxis

- Liquidity at Risk zur Steuerung des liquiditätsmäßig-finanziellen Bereichs auf geschäftstäglicher Basis im normalen Geschäftsbetrieb
- Analyse des LiqV-Standardverfahrens aus finanzwirtschaftlicher Sicht
- Schätzung bisher (noch) nicht beobachteter Liquiditätsanforderungen mit Hilfe der Extremwertstatistik
- Anwendung des Liquidity at Risk in der Gelddisposition in einer ertragsorientierten Banksteuerung
- Liquidity at Risk als mathematisch-statistische Diskussionsgrundlage für die bankbetriebliche Liquiditätsvorsorge

Dr. Stefan Zeranski

Leiter Treasury,

Kölner Bank eG, Köln



12.30 Gemeinsames Mittagessen

13.45 Liquiditätsrisiko-Controlling gemäß den MaRisk

- Veränderte Rahmenbedingungen im dynamischen Business-Umfeld
- Zentrale Handlungsfelder gem. den MaRisk
- Integrierte Projektplanung: Risiko-Controlling vs. Risikosteuerung
- Ausgewählte Problembereiche am Beispiel der Modellierung
- Systemauswahl



- Lessons learned
 - Weitere Ausbaustufen
- Dr. Günter Fiebach
Bereichsleiter Risikocontrolling,
Deutsche Postbank AG, Bonn

15.15 Kaffee- und Teepause

15.45 Tipps für die Umsetzung eines effizienten Liquiditäts-Treasury in der Praxis

- Optimale Aufgabenverteilung innerhalb des Kreditinstituts
- Notwendige aufbau- und ablauforganisatorische Maßnahmen
- Stand der Umsetzung in Deutschland
- Typische Probleme und Lösungsansätze
- Empfehlungen für Ihre Projektplanung

Abschließende Diskussion

- Welche „Lehren“ können aus der aktuellen Finanzkrise gezogen werden?
 - Welche Herausforderungen stehen in der Zukunft an?
 - Welche aktuellen aufsichtsrechtlichen Entwicklungen sind zu erkennen?
 - Intensiver Erfahrungsaustausch
- Dr. Peter Bartetzky

17.00 Ende des Intensiv-Seminars

AUCH ALS INHOUSE TRAINING

Zu allen Themenbereichen bieten wir auch firmeninterne Schulungen an. Ihre Vorteile: Kein Zeitverlust – passgenau für Ihren Bedarf! Ich berate Sie gerne und erstelle Ihnen ein individuelles Angebot. Rufen Sie mich an.



Christian Menzel

Tel.: 0 61 96/47 22-644

E-Mail: menzel@managementcircle.de

www.managementcircle.de/inhouse

Stimmen ehemaliger Seminarteilnehmer:

- **„Sehr gut organisiert, fachlich kompetente Referenten, die die Seminarinhalte auch sehr gut vermitteln können!“**
M. Müller, Sparkasse Saarbrücken
- **„Gute Mischung zwischen theoretischen Ansätzen und Praxis. Das Thema ist eine zukunftsorientierte, für alle Banken wichtige Herausforderung!“**
Mag. R. Kroboth, BAWAG P.S.K. Bank
- **„Sehr gute Veranstaltung!“**
A. Beck, Erste Europäische Pfandbrief- und Kommunalkreditbank AG

Warum dieses Seminar gerade jetzt für Sie wichtig ist

Die **aktuelle Finanzmarktkrise hat einmal mehr gezeigt, wie wichtig es ist, Liquiditätsrisiken jederzeit im Griff zu haben**, die strukturelle und dispositive Liquidität nachhaltig sicherzustellen und eine solide Refinanzierung zu gewährleisten.

Die renommierten Experten dieses Seminars, vermitteln Ihnen **konkrete Instrumente** und **Methoden** und zeigen Ihnen anhand zahlreicher aktueller Beispiele, wie Sie Ihr **Liquiditätsrisiko sicher ermitteln** und die **Liquidität** Ihres Instituts kurz-, mittel- und langfristig **effizient steuern**.

Intensiv diskutieren Sie, welche **Refinanzierungsalternativen** in der aktuellen Situation sinnvoll sind, welche **Maßnahmen sich in „Notfällen“ bewährt haben** und wie Sie die aktuellen und zu erwartenden nationalen und internationalen **aufsichtsrechtlichen Anforderungen** an Ihr Liquiditäts-Management perfekt erfüllen.

Ihre Themen auf einen Blick

- Aktuelle aufsichtsrechtliche Anforderungen sicher erfüllen!
- Auf künftige nationale und internationale Standards perfekt vorbereitet sein!
- Liquiditätsrisiken sicher messen, steuern und nachhaltig limitieren!
- Stresstests und Notfallszenarien strukturiert durchführen!
- Liquiditätsablaufbilanz sachgerecht erstellen!
- Ertragspotenziale aus der Liquiditätsfristentransformation effizient nutzen!
- Die passende Refinanzierungsstrategie wählen und die Refinanzierung nachhaltig optimieren!
- Sich optimal auf aufsichtliche Prüfungen vorbereiten!

Direkt umsetzbares Wissen

Sie lernen praxiserprobte Methoden und Instrumente kennen und profitieren von den **ausführlichen Praxisberichten** sowie dem **intensiven Erfahrungsaustausch** mit den Referenten und Ihren Kollegen aus dem Teilnehmerkreis.

Dieses Seminar ist das 2. Modul unserer Zertifizierungs-Reihe „Der Treasury Manager in Banken“.

Sie haben noch Fragen?

Rufen Sie mich an oder schreiben Sie mir eine E-Mail. Gerne berate ich Sie persönlich und beantworte Ihre Fragen zum Seminar.



Daniela Wolf

Senior Konferenz Managerin

Tel.: 0 61 96/47 22-559

E-Mail: daniela.wolf@managementcircle.de

Dr. Peter Bartetzky ist Geschäftsführer der **TriSolutions GmbH** in Hamburg, einer auf die Durchführung von Umsetzungsprojekten im Treasury-Umfeld spezialisierten Unternehmensberatung. Vor Beginn seiner Beratertätigkeit war Dr. Peter Bartetzky unter anderem tätig als Leiter Risikocontrolling. Zuletzt leitete er das Treasury in der Hamburger Sparkasse.

Dr. Günter Fiebach ist Leiter Risikocontrolling bei der **Deutsche Postbank AG** in Bonn und war in seiner vorherigen Position als Abteilungsleiter auch für das Projekt „Liquiditätsrisikocontrolling“ verantwortlich. Zuvor war er u.a. als Leiter Risikocontrolling bei der Vereins- und Westbank AG in Hamburg tätig.

Stefan Rehsmann ist in der Zentrale der **Deutschen Bundesbank** in Frankfurt/M. zuständig für die konzeptionelle Vorbereitung und die Bearbeitung von Grundsatzfragen hinsichtlich der Durchführung von Prüfungen im Bereich bankinterner Risikomess- und -steuerungsverfahren mit den Schwerpunkten Markt- und Liquiditätsrisiko.

Dr. Holger Thomae verantwortet als Partner der **TriSolutions GmbH** in Hamburg den Themenbereich Asset Liability Management (ALM) und Liquiditätsmanagement. Zuvor war Dr. Holger Thomae u.a. bei der Dresdner Bank AG als Abteilungsleiter für die Treasury IT zuständig.

Sven Wirth ist Prüfer bankinterner Risikomess- und -steuerungsverfahren für Liquiditäts-, Markt- und Operationelle Risiken bei der **Deutschen Bundesbank** in Frankfurt/M. Er hat an den ersten Zulassungsprüfungen bankinterner Liquiditätsrisikomodelle gemäß der neuen Öffnungsklausel der LiqV teilgenommen und bei der Konzeption und Durchführung von Liquiditätsstresstests des SoFFin mitgewirkt.

Dr. Stefan Zeranski ist Leiter Treasury der **Kölner Bank eG** in Köln sowie Lehrbeauftragter im Fach Finanzwirtschaft und Bankbetriebslehre. Zuvor war er als Leiter Aktiv-Passiv-Management in der SchmidtBank tätig. Er schrieb seine Dissertation über das Thema Liquidity at Risk. Die Arbeit wurde in 2005 mit dem Sonderforschungspreis 2004 der Commerzbank AG ausgezeichnet.

Ihr Ausbildungsprogramm zum zertifizierten Treasury Manager in Banken besteht aus vier Modulen:

Zins-Treasury (3 Tage)

+

Liquiditäts-Treasury (2 Tage)

+

Kredit-Treasury (3 Tage)

+

Gesamtbank-Treasury (2 Tage)

=

DER TREASURY MANAGER
in Banken

Aktuelle Termine für 2009 finden Sie im Internet unter
www.managementcircle.de/treasury

4 gute Gründe, dieses Seminar zu besuchen

- ① Die **Seminarinhalte** werden **top-aktuell** aufbereitet!
- ② Die **Referenten** sind ausgewiesene Experten im Liquiditäts-Management. **Sie geben Ihre Erfahrungen direkt an Sie weiter.**
- ③ Sie profitieren vom **intensiven Erfahrungsaustausch** mit Ihren Fachkollegen.
- ④ Sie erhalten eine **ausführliche Semindokumentation** zur Nachbereitung.

Wen Sie auf diesem Seminar treffen

Dieses Seminar richtet sich an Leiter und leitende Mitarbeiter der Bereiche **Treasury, Liquiditäts-Management, Gesamtbanksteuerung, Asset Liability Management, Refinanzierung, Controlling, Risiko-Controlling, Risiko-Management, Unternehmenssteuerung** und **Handel** sowie an **Vorstände** und **Geschäftsführer** aus Banken, Sparkassen und sonstigen Finanzdienstleistungsunternehmen. Ebenso angesprochen sind Mitarbeiter aus kreditwirtschaftlichen Verbänden und Unternehmensberatungen.

Termine und Veranstaltungsorte

27. und 28. April 2009 in Frankfurt/M.

Tryp Hotel Frankfurt,
Braunfelsstraße 17/Opelrondell, 60486 Frankfurt/M.
Tel.: 069/707 30-0, Fax: 069/707 30-333
E-Mail: tryp.frankfurt@solmelia.com

15. und 16. Juni 2009 in München

Holiday Inn Munich-Schwabing, Leopoldstraße 194, 80804 München
Tel.: 089/381 79-0, Fax: 089/381 79-888
E-Mail: reservation.hi-munich-schwabing@queensgruppe.de
Airport-Shuttle auf Anfrage

Zimmerreservierung

Für die Seminarteilnehmer steht im jeweiligen Tagungshotel ein begrenztes Zimmerkontingent zum Vorzugspreis zur Verfügung. Nehmen Sie die **Reservierung bitte rechtzeitig selbst direkt im Hotel** unter Berufung auf Management Circle vor. Die Anfahrtsskizze erhalten Sie zusammen mit der Anmeldebestätigung.



Mit der Deutschen Bahn ab € 79,- zur Veranstaltung.
Infos unter:

www.managementcircle.de/bahn



Über Management Circle

Management Circle steht für *WissensWerte* und ist anerkannter Bildungspartner der Unternehmen.

Die Management Circle AG zählt mit einem umfangreichen Weiterbildungsprogramm zu den **Marktführern** im deutschsprachigen Raum.

Informieren Sie sich aktuell und umfassend unter:
www.managementcircle.de

So melden Sie sich an

Bitte einfach die Anmeldung ausfüllen und möglichst bald zurücksenden oder per Fax, Telefon oder E-Mail anmelden. Die Anmeldungen werden nach Reihenfolge der Eingänge berücksichtigt.

Die Teilnahmegebühr für das zweitägige Seminar beträgt inkl. Mittagessen, Erfrischungsgetränken, Get-Together, dem Handbuch „Liquiditätsrisiko“ und der Dokumentation € 1.795,-. **Sonderkonditionen** erhalten Sie, wenn Sie die Zertifizierungs-Reihe „Der Treasury Manager in Banken“ buchen. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Sollten mehr als zwei Vertreter desselben Unternehmens an der Veranstaltung teilnehmen, bieten wir **ab dem dritten Teilnehmer 10% Preisnachlass**. Bis zu zwei Wochen vor Veranstaltungstermin können Sie kostenlos stornieren. Danach oder bei Nichterscheinen des Teilnehmers berechnen wir die gesamte Tagungsgebühr. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Selbstverständlich ist eine Vertretung des angemeldeten Teilnehmers möglich. Alle genannten Preise verstehen sich zzgl. der gesetzl. MwSt.

Liquiditäts-Treasury

Ich/Wir nehme(n) teil am:

WS

27. und 28. April 2009 in Frankfurt/M.

04-59982

15. und 16. Juni 2009 in München

06-59983

1	NAME/VORNAME
	POSITION/ABTEILUNG
2	NAME/VORNAME
	POSITION/ABTEILUNG
3	NAME/VORNAME
	POSITION/ABTEILUNG
	FIRMENNAME
	STRASSE/POSTFACH
	PLZ/ORT
	TELEFON/FAX

MITARBEITER: BIS 100 100-200 200-500 500-1000 ÜBER 1000

Warum Ihre E-Mail-Adresse wichtig ist!

Sie erhalten so schnellstmöglich eine Bestätigung Ihrer Anmeldung, damit Sie den Termin fest einplanen können.

E-MAIL
(MIT NENNUNG MEINER E-MAIL-ADRESSE ERKLÄRE ICH MICH EINVERSTANDEN, ÜBER DIESES MEDIUM INFORMATIONEN DER MANAGEMENT CIRCLE GRUPPE ZU ERHALTEN.)

DATUM UNTERSCHRIFT

ANSPRECHPARTNER/IN IM SEKRETARIAT:

ANMELDEBESTÄTIGUNG BITTE AN: ABTEILUNG

RECHNUNG BITTE AN: ABTEILUNG

Datenschutz-Hinweis: Sie können bei uns der Verwendung Ihrer Daten widersprechen, wenn Sie in Zukunft keine Prospekte mehr erhalten möchten. (§28 VI BDSG)

Anmeldung/Kundenservice



Telefon: **+49 (0) 61 96/47 22-700**

Fax: **+49 (0) 61 96/47 22-999**

E-Mail: **anmeldung@managementcircle.de**

Internet: **www.managementcircle.de/04-59982**

Postanschrift: **Management Circle AG**

Postfach 56 29, 65731 Eschborn/Ts.

Telefonzentrale: +49 (0) 61 96/47 22-0