



# TREASURYMANAGEMENT

Die Aufgaben der Treasury sind vielfältig und in jedem Institut unterschiedlich. Daher sind die Steuerung des Liquiditätsrisikos, das Management der Zinsänderungs- und Währungsrisiken und nicht zuletzt auch die Behandlung des Kreditrisikos wichtige Elemente.

Ziel dieses Seminars ist es, einen Überblick über die relevanten Themenstellungen im Treasuryumfeld zu vermitteln: Diese gehen von den Herausforderungen aus der Regulatorik und der Risikosteuerung über Instrumente bis hin zur Strategie. Praxisorientierte Beispiele vermitteln eine integrierte Gesamtbetrachtung.

## ZIELGRUPPE

Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter aus Risikocontrolling, Treasury/Handel und der internen Revision

## SEMINARINHALTE

### Einführung

- Einordnung wichtiger Begriffe
- Wirkungszusammenhänge und Abhängigkeiten in der Gesamtbank als Rahmenbedingungen für das Treasury

### Regulatorischer Rahmen

- Überblick über die wichtigsten Normen und Entwicklungen im Liquiditätsrisikoumfeld
- Rolle der Kennzahlen LCR und NSFR im Treasurymanagement

### Risikoarten im Treasury

- Treasuryansätze für das Liquiditäts-, Zinsänderungs- und Kreditrisiko
- Entstehung des Liquiditätsrisikos und Gegenüberstellung der Risikoarten

### Instrumente in der Steuerung

- Cashfloworientierte Steuerung
- Strukturierte Risikotransferinstrumente (ABS)
- Repogeschäfte

### Treasury-Setup und Steuerungsstrategien

- Abgrenzung typischer Steuerungsstrategien für Markt- und Adressrisiken: Spektrum von passiven bis aktiven Strategien
- Performancerechnung

- Risikolimitierung für den ICAAP: Risikosteuerung und –begrenzung mittels LVaR
- Methoden für Performancerechnung und Beispielrechnungen
- Vorstellung und Diskussion eines ganzheitlichen Steuerungsansatzes

## Organisatorische Aspekte im Treasuryprozess

## REFERENT

**Henning Heuter** ist geschäftsführender Partner der 1 PLUS i GmbH. Im Fokus seiner Tätigkeit steht das Themenfeld Risikosteuerung, das neben den Fragen des Risikomanagements auch deren aufsichtsrechtliche Behandlung umfasst. Er berät Kreditinstitute aller Institutsgruppen im In- und Ausland und ist als Seminartrainer aktiv. Schwerpunkte sind die Behandlung von Liquiditäts- und insb. Refinanzierungsrisiken in der Gesamtbank sowie die Prüfung und Weiterentwicklung von Risikotragfähigkeits- bzw. ICAAP-Systemen.

## SPRACHE

Deutsch

**Studienort**  
ONLINE (ZOOM)

**DAUER**  
1 TAG  
9 BIS 17 UHR

## TERMINE

16. Mai 2024

**790 €**

Preis zzgl. MwSt.

## FÜR FRAGEN UND WEITERE AUSKÜNFTE



DVFA GMBH

**Kerstin Oostendorp**

+49 69 2648 48 - 129

koo@dvfa.de

akademie.dvfa.de

[ZUM ANMELDEFORMULAR](#)

