

Controlling Handel Bilanz

NEUERSCHEINUNG



Dr. Stefan Zeranski (Hrsg.)
Leiter Treasury Kölner Bank eG

Dr. Bernd Walter
Leiter Risikocontrolling
Kasseler Sparkasse

Michael Schneider
Leiter Liquidität & Collateral
DZ Bank, Frankfurt

Thomas Rempel-Oberem
Associate Partner, Consulting
ifb group, Köln

Anja Albert
Laufende Aufsicht
Deutsche Bundesbank

Thomas Nordheim
Leiter Revision EDG Kie

Volker Schmidt
Leiter Geldhandel/Derivate
Helaba, Frankfurt

Ertragsorientiertes Liquiditätsrisikomanagement in mittelständischen Banken, 2. Auflage

**Aktueller Überblick über das Liquiditätsrisikomanagement
Regulierung und Revision des Liquiditätsrisikomanagement
Bankenaufsichtliche Zulassung interner Liquiditätsmodelle
Praxisbeiträge zur Messung und Steuerung des Liquiditätsrisikos**

- Checklisten zur Überprüfung des Liquiditätsmanagement



FCH-Treasury-Paket
139,- EUR
Kombi-Sonderpreis

Dr. Holger Thomae
Partner, Consulting
TriSolutions, Hamburg

Karsten Stickelmann
Leiter Prüfung Liquiditätsmodelle
Deutsche Bundesbank

Holger Nielsen
Stv. Leiter Treasury
Hamburger Sparkasse

Dr. Thomas Dietz
Dozent, Fachhochschule
Deutsche Bundesbank u. a.

Aus den §§ 11, 25a KWG und den Empfehlungen der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich resultiert die Forderung, dass Banken ein angemessenes Liquiditätsrisikomanagement haben müssen. Gemäß den Mindestanforderungen an das Risikomanagement (MaRisk) ist sicherzustellen, dass Liquiditätsrisiken adäquat in den Risikosteuerungs- und Controllingprozessen berücksichtigt werden. So muss sich beispielsweise die Geschäftsleitung einer Bank regelmäßig über die Liquiditätssituation informieren. Zudem fordern die MaRisk, dass jede Bank angemessene Systeme

zur Messung, Überwachung und Kontrolle des Liquiditätsrisikos einsetzt. Dabei schreiben die MaRisk bewusst keine bestimmten Methoden und Modelle vor. § 10 der Liquiditätsverordnung lässt interne Liquiditätsmodelle alternativ zum Standardverfahren zu, das den Grundsatz II ersetzt.

Viele Banken haben bereits eine wertorientierte Zinsbuchsteuerung umgesetzt. Geprägt von den Erfahrungen aus der Finanzkrise erkennen viele Institute nun in Zeiten rückläufiger Zinsspannen im Liquiditätsmanagement immer mehr ein Handlungsfeld, in dem sie durch ein ertragsorientiertes Liquiditätsrisikomanagement zusätzliche Erträge generieren und Liquiditätskosten vermeiden können. Dabei stehen Liquiditäts- und Erfolgsrisiken in enger Wechselwirkung, zumal Banken letztlich nur so viel Liquidität anlegen können, wie sie nicht unmittelbar zur Sicherstellung ihrer täglichen Zahlungsbereitschaft benötigen. Im Zuge der Finanzkrise kommt dem Liquiditätsrisikomanagement aus regulatorischer Sicht eine gestiegene Bedeutung zu.

Im Mittelpunkt der 2. Auflage stehen Beiträge aus der Praxis, die aufzeigen,

wie Banken derzeit ein ertragsorientiertes Liquiditätsrisikomanagement umsetzen. Die Autorengruppe ist unmittelbar mit dem Liquiditätsrisikomanagement im Umfeld von Sparkassen und Genossenschaftsbanken sowie der Bankenaufsicht betraut. Sie arbeitet die wichtigen Kernfragen für die Umsetzung eines ertragsorientierten Liquiditätsrisikomanagements in der Praxis heraus. Im Einzelnen werden aktuelle Schwerpunkte vermittelt, wobei die bisherigen Kapitel überarbeitet und neue Beiträge mit aufgenommen worden sind.

Stand:	15.04.2009
Erscheinungstermin:	15.06.2009
Umfang:	ca. 600 Seiten
Preis:	€ 86,-
ISBN:	978-3-936974-99-7

FCH-Treasury-Paket	
Liquiditätsmanagement, 2. Auflage + Zinsrisikomanagement (siehe Seite 24)	
Preis:	€ 139,-
ISBN:	978-3-936974-73-7