

Topaktuelles Wissen für die Bankpraxis:

Liquiditäts-Treasury

Erhöhen Sie Ihre Erträge durch eine optimierte Liquiditätssteuerung!

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

- Aktuelle aufsichtsrechtliche Anforderungen an Ihr Liquiditäts-Treasury sicher erfüllen
- Liquidität kurz-, mittel- und langfristig optimal steuern
- Liquiditätsrisiken adäquat abbilden
- Effizientes Controlling der Liquiditätsrisiken sicherstellen
- Ertragspotenziale aus der Liquiditätsfristen-transformation optimal nutzen
- Refinanzierungsstrategien nachhaltig verbessern
- Liquidity at Risk in der ertragsorientierten Banksteuerung optimal anwenden

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

Erfahrungsberichte,
praktische Tipps & konkrete
Lösungsansätze!

Ihr Seminarleiter:

Dr. Peter Bartetzky
TriSolutions GmbH

Direkt aus der Praxis:

Manfred Bier
Eurohypo AG

Dr. Günter Fiebach
Deutsche Postbank AG

Dr. Holger Thomae
TriSolutions GmbH

Dr. Stefan Zeranski
Kölner Bank eG

Special:
Jeder Teilnehmer erhält das
„Handbuch Liquiditätsrisiko“!



Bitte wählen Sie Ihren Termin:

5. und 6. Mai 2008 in Frankfurt am Main

2. und 3. Juni 2008 in München

Hoher Lernerfolg durch
begrenzte Teilnehmerzahl!

MANAGEMENTCIRCLE®
BILDUNG FÜR DIE BESTEN

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

Wesentliche Instrumente der kurz-, mittel- und langfristigen Liquiditätssteuerung

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 Zielsetzung des Seminars
- ◆ Abgleich mit den Teilnehmererwartungen

10.15 Liquidität, Liquiditätsrisiko, Liquiditätsrisiko-Management

- ◆ Die verschiedenen Liquiditätsarten
- ◆ Begriffsdefinitionen
- ◆ Praxisbeispiel Zins- und Liquiditätsrisiko-Management
- ◆ Trennung zwischen Zins- und Liquiditätsrisiko-Management
- ◆ Marktzinsmethode als Voraussetzung für ein modernes Treasury
- ◆ Bestimmung der risikoadäquaten Einstandssätze
- ◆ Gegenwärtige aufsichtsrechtliche Anforderungen
- ◆ Aktuelle internationale Entwicklungen

Dr. Peter Bartetzky

11.30 Kaffee- und Teepause

12.00 Liquiditätsrisiken sicher bewerten und managen

- ◆ Definition Liquiditätsrisiko
- ◆ Besonderheiten des Assets Liquidität
- ◆ Vergleich kurzes und langfristiges Liquiditäts-Management
- ◆ Liquiditätsbedarfsprognose, Optimierung der Refinanzierungsstrategie
- ◆ Liquiditätsrisikokosten
- ◆ Praxisorientierte Abbildung der Liquiditätsrisiken
- ◆ Spezialfälle und Besonderheiten beim Management von Liquiditätsrisiken
- ◆ Lambda, der letzte Grieche...

Dr. Holger Thomae

Partner, **TriSolutions GmbH**, Hamburg

13.30 Gemeinsames Mittagessen

14.45 Integriertes Liquiditätsrisiko-Management in der Praxis

- ◆ Funds Transfer Pricing und P&L für das Liquiditätsrisiko
- ◆ Risiko-Controlling im Bereich Liquiditätsrisiko
- ◆ Positionsbestimmung, Risikobestimmung, Limitierung
- ◆ Einteilung und Modellierung der Cashflows
- ◆ Nutzung von Ertragspotenzialen aus der Liquiditätsfristentransformation
- ◆ Aufgabenverteilung innerhalb des Kreditinstitutes
- ◆ Notwendige aufbau- und ablauforganisatorische Maßnahmen

Dr. Peter Bartetzky

16.15 Kaffee- und Teepause

16.45 Erfolgreiche Refinanzierungsstrategien

- ◆ Mögliche Refinanzierungsalternativen
- ◆ Geschäftspolitische Maßnahmen, Setzen der richtigen Steuerungsimpulse
- ◆ Bonität, Rating und Liquidität
- ◆ Entwicklung der Bonitäts-Spreads
- ◆ Vorgehensweise der Rating-Agenturen
- ◆ Herausforderungen in der Zukunft

Dr. Peter Bartetzky

17.45 Zusammenfassung der Ergebnisse des Tages und Gelegenheit zur Diskussion

18.00 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!

INHOUSE TRAINING

Zu diesen und anderen Themen bieten wir auch firmeninterne Schulungen an. Wir beraten Sie gerne und erstellen ein individuelles Angebot.

Dirk Gollnick, Tel.: 0 61 96/47 22-646, E-Mail: gollnick@managementcircle.de

Erfolgreiches Liquiditäts-Management in der Praxis

Ihr Seminarleiter:
Dr. Peter Bartetzky

Praxisbericht
Eurohypo

9.00 Begrüßung und Überleitung zum zweiten
Seminartag

9.05 Kurzfristige Liquiditätssteuerung in der Praxis

Praxisbericht
Kölner Bank

- ◆ 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

10.30 Kaffee- und Teepause

11.00 Liquiditätsrisiko-Controlling gemäß den MaRisk

Praxisbericht
Postbank

- ◆ 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

12.30 Gemeinsames Mittagessen

13.45 Liquiditätsmaßnahmen für den Stressfall und das Management von Stressfällen

- ◆ Definition und Ermittlung der Stressfälle
- ◆ Quantitativer und geschäftspolitischer Rahmen
- ◆ Operative Richtlinien und Abläufe
- ◆ Die Aufgaben des Treasurers im Stressfall
- ◆ Schlüsselemente für eine erfolgreiche Bewältigung der Stresssituation

Manfred Bier, Head of Treasury,
Eurohypo AG, Frankfurt am Main

15.15 Kaffee- und Teepause

15.45 Tipps für die Umsetzung in der Praxis

- ◆ Typische Probleme in der Praxis
- ◆ Stand der Umsetzung in Deutschland
- ◆ Checkliste
- ◆ Empfehlungen für die Projektplanung
- ◆ Fazit und Ausblick
- ◆ Abschließende Diskussion

Dr. Peter Bartetzky

ca.

17.00 Ende des Intensiv-Seminars

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

Die aktuellen Termine für 2008 finden Sie
im Internet unter

www.managementcircle.de/banken

Zum Seminarinhalt

Warum dieses Seminar für Sie wichtig ist

Ihre Aufgabe ist es, vor dem Hintergrund der aktuellen aufsichtsrechtlichen Anforderungen **die strukturelle und dispositive Liquidität Ihres Hauses zu einem wettbewerbsfähigen Preis jederzeit sicherzustellen.**

Die Experten dieses Seminar zeigen Ihnen, wie Sie die aufsichtsrechtlichen Anforderungen sicher erfüllen, Liquiditätsrisiken frühzeitig erkennen und bewerten und durch langfristige Liquiditätsplanung sowie kurzfristige Liquiditätsdisposition Ihre Liquidität erfolgreich steuern.

Was Sie hier lernen

Sie lernen im Detail, wie Sie

- die aktuellen aufsichtsrechtlichen Anforderungen aus **Basel II** und **MaRisk** in der Praxis sicher erfüllen
- Ihre **kurz-, mittel- und langfristige Liquidität** erfolgreich steuern
- die **Liquiditätsrisiken** adäquat **abbilden** und ein **nachhaltiges Risiko-Controlling** sicherstellen
- die Ertragspotenziale aus der **Liquiditätsfristen-transformation** optimal nutzen
- Ihre **Refinanzierungsstrategien** optimieren
- durch die **Diversifizierung** der Produktpalette Ihre **Refinanzierungsbasis stärken**
- den **Liquidity at Risk** in der kurzfristigen Banksteuerung anwenden

Direkt umsetzbares Wissen

Profitieren Sie von den **drei konkreten Erfahrungsberichten** Ihrer Branchenkollegen und nutzen Sie die Gelegenheit zum **intensiven Erfahrungsaustausch** mit den Referenten und Fachkollegen.

Die theoretischen Vortragelemente werden durch viele **Praxisbeispiele** und **Checklisten** ergänzt, so dass der Transfer in Ihren Berufsalltag sichergestellt wird.

Dieses Seminar ist das 2. Modul unserer Zertifizierungsreihe „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 zur Veranstaltung.



Daniela Wolf

Daniela Wolf

Senior Konferenz Managerin

Tel.: 0 61 96/47 22-559

E-Mail: daniela.wolf@managementcircle.de

Special:
Jeder Teilnehmer erhält das „Handbuch Liquiditätsrisiko“!



Ihre Referenten

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 Wertpapier- und Derivatehändler, Wertpapiermanager und Leiter Risikocontrolling. Zuletzt leitete er das Treasury in der Hamburger Sparkasse.

Manfred Bier

ist Head of Treasury der **Eurohypo AG** in Eschborn und für die Steuerung der Zins- und Währungsrisiken des Bankbuchs verantwortlich. Bis April 2007 war er als Head of Liquidity in der Group Treasury der Commerzbank AG in Frankfurt am Main für die Steuerung der kurzfristigen Liquidität der Commerzbank AG verantwortlich. Zuvor war Manfred Bier im Devisen-, Zins- und Zinswährungs-Swap-Handel sowie im Repo- und Bond-Handel tätig.

Dr. Günter Fiebach

ist Bereichsleiter Risikocontrolling bei der **Deutsche Postbank AG** in Bonn und war in seiner vorherigen Position als Abteilungsleiter auch für das Projekt „Liquiditätsrisiko-Controlling“ verantwortlich. Zuvor war er als Leiter Risikocontrolling bei der Vereins- und Westbank AG in Hamburg sowie als Abteilungsleiter im Controlling des Unternehmensbereichs Finanzdienstleistungen bei der Deutsche Post AG in Bonn tätig.

Dr. Holger Thomae

verantwortet als Partner der **TriSolutions GmbH** in Hamburg den Themenbereich Asset Liability Management (ALM) und Liquiditäts-Management. In dieser Funktion begleitet er u.a. Projekte in den Bereichen Markt-, Kredit- und Liquiditätsrisiko, Einführung von Handelssystemen und Prozessanalyse sowie Projekte in den Bereichen Basel II, Validierung von Risiko-Modellen und Konzeption und Planung von ALM-Lösungen. Zuvor war Dr. Holger Thomae u.a. bei der Dresdner Bank AG als Abteilungsdirektor für die Treasury IT zuständig.

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.

Stimmen ehemaliger Seminarteilnehmer:

- **„Sehr gut organisiert, fachlich kompetente Referenten, die die Seminarinhalte auch sehr gut vermitteln können!“**, M. Müller, Sparkasse Saarbrücken
- **„Sehr gutes Seminar über ein bisher wenig diskutiertes Thema!“**, S. Schukat, Berlin-Hannoversche Hypothekenbank AG
- **„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

3 gute Gründe, dieses Seminar zu besuchen

- 1 Die **Referenten** sind ausgewiesene Experten im Liquiditäts-Management. **Sie geben Ihre Erfahrungen direkt an Sie weiter.**
- 2 Sie profitieren vom **intensiven Erfahrungsaustausch** mit Ihren Fachkollegen.
- 3 Sie erhalten eine **ausführliche Seminardokumentation** 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, Controlling, Risiko-Controlling und -Management, Unternehmenssteuerung, Handel** sowie an **Vorstände** und **Geschäftsführer** aus Banken, Sparkassen und sonstigen Finanzdienstleistungsunternehmen. Ebenso angesprochen sind Mitarbeiter aus **kreditwirtschaftlichen Verbänden**. Interessant ist das Seminar auch für Unternehmensberater, die auf dieses Thema spezialisiert sind.

Termine und Veranstaltungsorte

5. und 6. Mai 2008 in Frankfurt am Main

Steigenberger Hotel Frankfurt-City, Lange Straße 5-9, 60311 Frankfurt
Tel.: 069/219 30-0, Fax: 069/219 30-599
E-Mail: frankfurt-city@steigenberger.de

2. und 3. Juni 2008 in München

Sheraton München Arabellapark vorher ArabellaSheraton Bogen.
Arabellastraße 5, 81925 München
Tel.: 089/92 32-0, Fax: 089/92 32-44 49
E-Mail: muenchen.reservation@arabellasheraton.com

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.

So melden Sie sich an

Bitte einfach die Anmeldung ausfüllen und möglichst bald zurücksenden oder per Fax, Telefon oder E-Mail anmelden. Sie erhalten eine Bestätigung, sofern noch Plätze frei sind – andernfalls informieren wir Sie sofort. Die Anmeldungen werden nach Reihenfolge der Eingänge berücksichtigt.

Ihre Service-Hotlines

Anmeldung:

Bettina Gräf

Telefon: 0 61 96/47 22-700 oder
0 61 96/47 22-0 (Telefonzentrale)
Fax: 0 61 96/47 22-999

Per Post: Management Circle AG
Postfach 56 29, 65731 Eschborn/Ts.
Hauptstraße 129, 65760 Eschborn/Ts.
E-Mail: anmeldung@managementcircle.de

Kundenservice:

Eberhard Bergmann

Telefon: 0 61 96/47 22-800 (Fax: -888)
E-Mail: kundenservice@managementcircle.de

Adressänderung:

Stella Avramidou

Telefon: 0 61 96/47 22-500 (Fax: -562)
E-Mail: marketingservice@managementcircle.de

Datenschutz-Hinweis:

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

Die Teilnahmegebühr für das zweitägige Seminar beträgt inkl. Mittagessen, Erfrischungsgetränken, Get-Together und der Dokumentation € 1.695,-. **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 gesetzlichen MwSt.

Liquiditäts-Treasury

Ich/Wir nehme(n) teil am:

ws

5. und 6. Mai 2008 in Frankfurt am Main

05-55942

2. und 3. Juni 2008 in München

06-55943

1 NAME/VORNAME

POSITION/ABTEILUNG

2 NAME/VORNAME

POSITION/ABTEILUNG

3 NAME/VORNAME

POSITION/ABTEILUNG

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

FIRMENNAME

STRASSE/POSTFACH

PLZ/ORT

TELEFON/FAX

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 DIESESE MEDIUM INFORMATIONEN DER MANAGEMENT CIRCLE GRUPPE ZU ERHALTEN.)

DATUM

UNTERSCHRIFT

ANSPRECHPARTNER/IN IM SEKRETARIAT:

ANMELDEBESTÄTIGUNG BITTE AN:

ABTEILUNG

RECHNUNG BITTE AN:

ABTEILUNG

Bitte rufen Sie mich an, ich interessiere mich für

- Inhouse Trainings
- E-Learning
- Ausstellungs- und Sponsoringmöglichkeiten



Mit der Deutschen Bahn AG zum Sonderpreis zur Veranstaltung. Infos unter:

www.managementcircle.de/bahn



Über Management Circle

Management Circle steht für *WissensWerte* und ist anerkannter Bildungspartner der Unternehmen. Mit kompetenten Bildungsleistungen garantieren wir durch unsere Erfahrung Fach- und Führungskräften nachhaltigen Lernerfolg. Vom praxisnahen Seminar bis zur richtungsweisenden Kongressmesse – vom individuell konzipierten In-house Training, praxisorientierten schriftlichen Management-Lehrgang bis zum innovativen E-Learning erhalten Sie alles aus einer Hand. Mit über 40.000 Teilnehmern bei unseren Präsenzveranstaltungen im vergangenen Jahr gehört die Management Circle AG zu den Marktführern im deutschsprachigen Raum. Unser aktuelles und vollständiges Bildungsangebot finden Sie unter: www.managementcircle.de.

Aktuelle Veranstaltungsangebote: www.managementcircle.de