

# Likviditetsrisiko - måling og styring

Kursus i København

09.00 **Velkomst og introduktion**

09.15 **1. Introduktion til likviditetsrisikostyring**

- Definitioner
- Likviditetsrisikostyring
- BIS anbefalinger
- Subprime-krisen

10.15 **Kaffepause**

10.30 **2. Likviditetsnøgletal**

- Et kig på balancen
- Off-balance produkter
- Nøgletal
- BIS anbefalinger og EU-regulering
- Funding Diversificering
- Liquidity Coverage Ratio
- Net Stable Funding Ratio
- Additional Liquidity Monitoring Metrics
- Workshop

12.00 **Frokost**

13.00 **2. Likviditetsnøgletal, fortsat**

14.00 **3. GAP-analyse**

- Tidselementet i likviditetsstyring
- Likviditetskurven
- Liquidity at Risk
- Workshop

14.45 **Kaffepause**

15.00 **4. Stresstesting og Contingency Funding Plan**

- Markedslikviditetsrisiko
- Stresstesting med scenarier
- Contingency Funding Plan

16.00 **Afslutning på kurset og evaluering**

## Pris

Prisen for kurset er DKK 7.000 ex moms. Prisen inkluderer kursusmateriale og forplejning.

