

Likviditetsrisiko - måling og styring

Online kursus

Kapitel 1 - Introduktion til likviditetsrisikostyring

- Definitioner
- Likviditetsrisikostyring
- BIS anbefalinger
- Subprime-krisen

Kapitel 2 – Likviditetsnøgletal

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

Kapitel 3 - GAP-analyse

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

Kapitel 4 - Stresstesting og Contingency Funding Plan

- Markedslikviditetsrisiko
- Stresstesting med scenarier
- Contingency Funding Plan

Pris

Prisen for kurset er DKK 6.000. Prisen inkluderer optaget undervisning med mulighed for at stille spørgsmål, øvelser, bogen Finansiell Risikostyring og en times individuelt webinar.

