

An die Kreditgenossenschaften

Peter-Müller-Str. 26
40468 Düsseldorf
Telefon 0251 7186-0
Telefax 0251 7186-9398

Bereich Prüfung
Kreditgenossenschaften I
Rundschreiben K049/2015
Dr. Daniel J. Goebel
Durchwahl 0251 7186-2616
Direktfax 0251 7186-2099
E-Mail daniel-
johannes.goebel@rwgv.de

Düsseldorf, 4. Mai 2015

Praxisforum Liquidity Coverage Ratio

Sehr geehrte Damen und Herren,

zukünftig möchten wir in Praxisforen den konstruktiven Meinungs- und Erfahrungsaustausch zwischen Ihnen untereinander und zwischen Ihnen und dem RWGV themenbezogen weiter fördern. Den Auftakt hierzu wird am 7. Juli 2015 in der Zeit von 13:30 bis 17:00 Uhr in Forsbach das Thema „Liquidity Coverage Ratio (LCR)“ mit den Schwerpunkten „Meldung“ und „Strategie“ bilden.

Der Termin zur Einführung und Meldung der Kennzahl „LCR“ rückt näher; ab dem 1. Oktober 2015 sind alle Institute zur Einhaltung der LCR in Höhe von 60 % verpflichtet. Aus Ihren bisherigen Rückmeldungen und Anfragen sowie den Diskussionen in den von uns zu diesem Thema besetzten Verbundgremien sehen wir zu den folgenden Punkten vermehrt Diskussionsbedarf:

- Erfahrungsaustausch „Meldung“:
 - Liquide Aktiva (Zähler): LCR und GENO SAVE, Umgang mit Repo- und Offenmarktgeschäften
 - Zahlungsmittelabflüsse (Nenner): Abflüsse Privatkundeneinlagen
 - Zahlungsmittelzuflüsse (Nenner): Entwicklungen zur „Verbundliquidität“, Erfassung von Wertpapier-Tilgungen

- Erfahrungsaustausch „Strategie“
 - Nutzung des LCR Rechentools
 - Auffälligkeiten bei der Feststellung des „status quo“
 - Simulation von Portfolio-Umschichtungen
 - Aussagekraft und strategische Implikationen

Die ca. dreistündige Veranstaltung richtet sich in erster Linie an Führungskräfte und Praktiker im Rechnungswesen/Meldewesen bzw. Controlling. Bitte beachten Sie, dass es sich nicht um eine Seminar- oder Vortragsveranstaltung handelt; vielmehr ist ein aktiver Austausch der Teilnehmer gewünscht und erforderlich.

Von der RWGA erhalten Sie zeitnah ein Angebot zu dieser Veranstaltung mit weitergehenden organisatorischen Informationen zur Anmeldung. Der Termin ist auf maximal 20 Teilnehmer begrenzt. Bei entsprechender Nachfrage werden wir Ihnen weitere Termine anbieten. Ihre Investition beträgt 210,00 Euro inkl. Bewirtungskosten.

Sollten Sie weitere Punkte mit Ihren Kolleginnen und Kollegen bzw. mit uns diskutieren wollen, richten Sie Ihre Vorschläge bitte an meldewesen@rwgv.de mit dem Betreff „Praxisforum Liquidity Coverage Ratio am 7. Juli 2015“.

Mit freundlichen Grüßen

Rheinisch-Westfälischer Genossenschaftsverband e. V.



Siegfried Mehring

i. V.



Ludwig Lippes