

Anhang I – Tabelle zum Liquiditätsrisikomanagement

Tabelle zu qualitativen/quantitativen Informationen des Liquiditätsrisikos gemäß Artikel 435 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Zweck: Offenlegung von Risikomanagementzielen und Liquiditätsrisikostراتيجien
Anwendungsbereich: Der Anwendungsbereich richtet sich nach den Vorgaben unter Nrn. 1 und 3 dieses Rundschreibens
Inhalt: Qualitative und quantitative Informationen
Häufigkeit: Mindestens einmal pro Jahr
Format: Flexibel

Strategien und Prozesse im Liquiditätsrisikomanagement	
Struktur und Organisation der Liquiditätsrisikomanagement-Funktion (Behörde, Satzung, sonstige Vereinbarungen)	
Umfang und Art der Liquiditätsrisikomelde- und -messsysteme	
Strategien zur Absicherung und Abschwächung des Liquiditätsrisikos und Strategien und Prozesse zur Überwachung der fortlaufenden Wirksamkeit von Absicherungen und Abschwächungen	
Eine von der Geschäftsleitung genehmigte Erklärung zur Angemessenheit des Liquiditätsrisikomanagements des Instituts, welche die Angemessenheit im Hinblick auf das Profil und die Strategie des Instituts bestätigt	
Eine von der Geschäftsleitung genehmigte prägnante Darstellung der Liquiditätsrisikostategie, die kurz und bündig das gesamte mit der Geschäftsstrategie verbundene Liquiditätsrisikoprofil des Instituts beschreibt. Diese Darstellung enthält zentrale Kenngrößen und -zahlen (mit Ausnahme derjenigen, die bereits in Anhang II dieser Leitlinien erfasst sind), die einen umfassenden Überblick über das Liquiditätsrisikomanagement des Instituts bieten, und behandelt auch die Frage, wie das Liquiditätsrisikoprofil des Instituts mit der von der Geschäftsleitung festgelegten Risikotoleranz zusammenwirkt	