

Seminar

Umsetzung einer tragfähigen Asset Allokation in die Systeme der Gesamtbanksteuerung

Dozenten:

Jan Kühne, ifb AG

Heimo Scherer, ifb AG

Termin:

27.02.2012

NEU

Ihr Erfolg ist unsere Motivation.

Diese Veranstaltung richtet sich an:

Vorstände und Umsetzungsverantwortliche aus den Bereichen Treasury und Risikomanagement

Diskrepanzen zwischen Modellannahmen und Realität führen bei der Umsetzung der Asset Allokation häufig zu unerwarteten Verlusten bzw. zum Verlassen der strategischen Allokation in volatilen Marktphasen. Die folgende Marktberuhigung einhergehend mit Wertsteigerungen kann dann nicht mehr gewinnbringend genutzt werden. Um dies zu verhindern, ist ein Prozess zu definieren, wie die Asset Allokation in die Institutssteuerung zu integrieren ist.

Herausforderungen des Marktumfelds und zunehmend strengere regulatorische Anforderungen werden das Ertragspotenzial der Kreditinstitute in Zukunft weiter reduzieren. Gleichzeitig stehen die Institute vor der Herausforderung, ihre Robustheit auch in Stressphasen zu verbessern. In diesem Spannungsfeld gewinnt die Vernetzung der Asset Allokation mit der Gesamtbanksteuerung an Bedeutung. Eine robuste Asset Allokation verkraftet Stresssituationen und daraus resultierende Marktvolatilitäten wie es in den MaRisk gefordert wird.

Im Seminar werden Zusammenhänge und Abhängigkeiten zwischen der Asset Allokation und der Gesamtbanksteuerung verdeutlicht und Verbesserungsvorschläge aufgezeigt.

Ihr Nutzen:

- Modellannahmen einer strategischen Asset Allokation werden auf ihre Praxistauglichkeit überprüft. Abweichungen zwischen Modell und Umsetzung werden quantifiziert
- Zusammenhänge zwischen Asset Allokation, Risikotragfähigkeit und Stress-Szenarien werden praxisnah aufgezeigt
- Fallstricke der Umsetzung einer Asset Allokation werden aufgezeigt und es werden praxisnahe Lösungsansätze vorgestellt
- Aufsichtsrechtliche Rahmenbedingungen und deren Wirkung auf Struktur, Ertrag und Risiko werden diskutiert

Inhaltsschwerpunkte:

Risikotragfähigkeit

- Abgleich der Modellannahmen mit der Umsetzbarkeit in konkrete Produkte unter den organisatorischen Rahmenbedingungen des Instituts
- Überprüfung der Methoden zur Risikoquantifizierung neuer Produkte und Integration der Asset Allokation in die Gesamtbank-Risikotragfähigkeit
- Entwicklung historischer und hypothetischer Stresstests für die Asset Allokation

Strategie

- Voraussetzung für eine erfolgreiche Asset Allokation und ein erfolgreiches Portfoliomanagement
- Optimierung der Eigenanlagen und Eigenanlagenstrategie unter Vermeidung von Teilrisiken und volatilen Bewertungsergebnissen.
- Auswahl eines Steuerungsansatzes
- Berücksichtigung aufsichtsrechtlicher Rahmenbedingungen (z.B. MaRisk, Basel III, NPP, Konzentrationen, Limitvergabe und -überprüfung)

Steuerung

- Ableitung strategischer und taktischer Bandbreiten und deren Integration in die Risikotragfähigkeit
- Berücksichtigung eines Risikofrühwarnsystems.
- Abgleich der präferierten Anlagestrategie,- richtlinien mit der Asset Allokation
- Beachtung Markttiming und Hedgestrategien
- Auswirkung der neuen Liquiditätskennzahlen LCR und NSFR auf die Asset Allokation und auf die Eigenanlagen-Strategie
- Erfolgsmessung, Reporting und Ergebnisaufspaltung
- Moderne Kennzahlen zur Beurteilung des Ertrags- und Risikoprofils

ORGANISATORISCHES

Ihre Dozenten:

Jan Kühne, ifb AG, ist Managing Consultant der ifb AG. Er berät Kreditinstitute zu den Themen Aufsichtsrecht, Risikomanagement und Treasury. Seine Beratungsschwerpunkte sind insbesondere die Umsetzung der MaRisk im Eigenhandel, Gesamtbank-Risikotragfähigkeitsrechnung, Marktpreis- und Liquiditätsrisikomanagement sowie Steuerung der Eigenanlagen.

Heimo Scherer, ifb AG, ist Managing Consultant der ifb AG. Er berät Banken zu den Themen Treasury und Liquiditätssteuerung. Seine Beratungsschwerpunkte sind insbesondere die strategische Optimierung der Zinsbuchsteuerung, die Asset Allokation in Eigenanlagen, das Portfoliomanagement sowie das Liquiditätsmanagement gemäß neuester regulatorischer Anforderungen.

Preise:

EUR 525,- für Mitglieder der ADG/des Fördervereins
EUR 660,- für Nicht-Mitglieder

Termin/Anmelde-Nr.:

27.02.2012 (SB212-413)

Umsetzung einer tragfähigen Asset Allokation in die Systeme der Gesamtbanksteuerung

Institut

Bankleitzahl Ihres Institutes

Name, Vorname

Straße/Postfach

PLZ/Ort

Position

E-Mail

Telefon

Telefax

Datum Unterschrift und Stempel

Wir buchen Ihnen automatisch ab dem Vorabend der Veranstaltung ein Zimmer im Hotel inklusive aller zusätzlichen Leistungen. Wenn Sie nicht am Vorabend anreisen oder gar keine Übernachtung benötigen, kreuzen Sie bitte an: keine Vorabendanreise keine Übernachtung
Mit welchem Verkehrsmittel werden Sie anreisen? Bahn PKW PKW-Mitfahrer

ANSPRECHPARTNER FÜR INHALTLICHE FRAGEN

Selbstverständlich stehen wir Ihnen auch gerne für weitergehende Fragen oder Informationen zur Verfügung.

Bachelor of Business Administration (BBA)

Helena Schuck

Produktmanagerin

T: 02602 14-112

F: 02602 1495-112

helena_schuck@adgonline.de

ANMELDUNG/ORGANISATORISCHE FRAGEN

Servicecenter Seminare

T: 02602 14-500

F: 02602 1495-500

service@adgonline.de

Akademie Deutscher Genossenschaften ADG

Schloss Montabaur | 56410 Montabaur

www.adgonline.de

Ein Angebot im Rahmen des ADG-Jahresprogramms 2011

Banksteuerung, Risikomanagement und Treasury

