

Seminarangebot

Risiko- und Liquiditätsmanagement in der Kapitalanlage

Der deutliche Anstieg von Liquiditäts-, Verlust- und Ausfallrisiken bei Kapitalanlagen im Zuge der weltweiten Finanz- und Schuldenkrise hat private wie institutionelle Investoren veranlasst, ihre Anlageziele und –strategien zu überdenken und neu auszurichten. Neben Ertrags-erwartungen spielen beim Kauf wie bei der Verwaltung von Wertpapieren Liquiditäts- respektive Risikoüberlegungen eine zunehmend wichtigere Rolle. Zum Zwecke des Anlegerschutzes sowie der nachhaltigen Sicherung von Sondervermögen hat der Gesetzgeber zudem in jüngster Zeit die regulatorischen Anforderungen für die private und institutionelle Kapitalanlage verschärft.

Seminarziele

Solide Renditechancen bei überschaubarem Risiko und hinreichender Marktliquidität zu eröffnen und zu sichern – auf diese kurze Formel lässt sich eine risikoorientierte und nachhaltige Anlagestrategie bringen. Welche Schritte zum Aufbau, zur Umsetzung und zur Kontrolle bzw. Auswertung einer solchen Strategie erforderlich sind, soll im Rahmen dieses Seminars vermittelt werden. Sensibilisiert werden soll dabei auch für die Bedeutung, die der systematischen Messung und Überwachung der Liquidität der einzelnen Vermögensgegenstände zukommt.

Zu diesem Zweck werden die Teilnehmer mit den modernen Methoden und Verfahren zur Messung und Analyse des Risikos und der Liquidität unterschiedlichster Anlageprodukte vertraut gemacht und in der praktischen Anwendung dieser Verfahren unter Nutzung von Excel geschult. Die Teilnehmer werden ferner in die Lage versetzt, auf Basis verschiedener Risikomaße eine adäquate Asset Allocation und eine Portfolio-Optimierung unter Liquiditätsrestriktionen durchzuführen sowie verschiedene Wertsicherungskonzepte hinsichtlich ihrer praktischen Umsetzbarkeit zu vergleichen und zu bewerten.

Programm

- Risiko- und Liquiditätspräferenzen von Anlegern
- Aufsichtsrechtliche Vorgaben zur Messung und Steuerung von Risiko und Liquidität (DerivateV, Risikoklassifizierung nach KID, Stresstest-Vorgaben, InvMaRisk)
- Spezifische Risiko-Parameter für verschiedene Asset Klassen
- Messung von Liquidität und Liquiditätsrisiken
- Excel-Fallstudie: Moderne Verfahren zur Risikomessung und –analyse für verschiedene Asset Klassen
- Excel-Fallstudie: Internationale Asset Allocation bei unterschiedlichen Risikomaßen
- Excel-Fallstudie: Portfolio-Optimierung unter Liquiditätsrestriktionen
- Excel-Fallstudie: Asset Allocation mit und ohne Wertsicherung
- Excel-Fallstudie: Statische versus dynamische Wertsicherungskonzepte

Methoden

Vortrag, Diskussion, Erfahrungsaustausch, Fallbeispiele, Gruppenarbeiten, Excel-Übungen

Zielgruppen

Mitarbeiter von Banken, Kapitalanlagegesellschaften und sonstigen institutionellen Anlegern in den Bereichen Anlageberatung, Vermögensverwaltung und Vertriebssteuerung

Voraussetzungen

Studium oder äquivalente Ausbildung in einem fachnahen Bereich, mehrjährige berufliche Erfahrung; Excel-Kenntnisse

Dozenten

Dr. Christian Funke
(Source For Alpha)
Marc Becker
(XTP Transaction-Partners GmbH)

Veranstaltungsort

Frankfurt am Main

Dauer

08.03. - 09.03.2012 (2 Tage)

Max. Teilnehmerzahl

20 Personen

Teilnahmegebühr

1.450,00 EUR
(zzgl. gesetzlicher MwSt.)

Dieses Seminar ist auch als
In-House Veranstaltung buchbar.

Kontakt:

EDA
vwd academy AG
Bettinastraße 59
60325 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 768075-20
Telefax: +49 69 768075-19
E-Mail: mail@ed-academy.com
Web: ed-academy.com