Akademie der
Sparkassen-Finanzgruppe Saar

Spreadrisiko- und Marktpreisrisikosteuerung

Seminarnummer	05.222.01
Termin	Mittwoch, den 25.09.2019
- Zeit	09:00 Uhr bis 17:00 Uhr
- Ort	Sparkassenakademie Hessen-Thüringen
- Referent/in	Christian Bachert, msgGillardon AG
Zielgruppen	Erfahrene Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Risikocontrolling und Kalkulation

Zielsetzung

- Es werden zunächst die wesentlichen Einflussfaktoren auf die Erfolgskomponenten 'Zinsüberschuss' und 'Bewertungsergebnis Wertpapiere' dargestellt. Hierbei wird auf die Einflussfaktoren Marktpreise (Zinsen und Kurse), Liquiditätsspreads und Credit-Spreads eingegangen
- Neben der Validierung der zu definierenden Verfahren und Parameter werden auch die Einflüsse auf das Zinsspannenrisiko und das Bewertungsergebnis aus Wertpapieren eingegangen
- Auf die bei den Sparkassen möglichen Umsetzungen in SimCorpDimension und sDIS OSPlus wird genauso Bezug genommen wie auf alternative Berechnungen für Spezialthemen wie Bewertungseinheiten und Abschreibungen bei Aktien oder anderen zinsunabhängigen Assets
- Die Teilnehmer/-innen profitieren im Workshop vom Austausch mit Experten anderer Sparkassen und sind über die aktuellen Entwicklungen informiert

Inhalte

- Einflussfaktoren auf das Marktpreisrisiko
  - Zinsszenarien
  - Liquiditätsspreads
  - Credit-Spread-Szenarien
- Validierung der Methoden, Verfahren und Parameter
- Messung des Zinsspannenrisikos
- Messung des Bewertungsergebnisses Wertpapiere
- Ausblick (u.a. Auswirkung der veränderten Rahmenbedingungen)

Voraussetzungen

Kenntnisse in den Anwendungen der Integrierten Zinsbuchsteuerung und SimCorpDimension sind vorteilhaft, aber nicht zwingend notwendig

Hinweis

Der Expertenworkshop findet ohne PC's statt.

Die Veranstaltung wird in Kooperation mit der Sparkassenakademie

Akademie der
Sparkassen-Finanzgruppe Saar

Hessen-Thüringen angeboten.

Bitte melden Sie Ihre Teilnehmer/-innen für dieses Seminar direkt bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen an.

Sparkassenakademie Hessen-Thüringen

Meldeschluss Mittwoch, den 28.08.2019