

Anwenderschulung zur wertorientierten Zinsbuchsteuerung

Seminarnummer	05.202.93.02
Termin	Montag, den 28.10.2019 bis Dienstag, den 29.10.2019
- Zeit	09:00 Uhr bis 17:00 Uhr
- Ort	Sparkassenakademie Hessen-Thüringen
- Referent/in	Klaus Stechmeyer-Emden, msgGillardon AG
Zielgruppen	Mitarbeiter/-innen der Integrierte Zinsbuchsteuerung und Ergebnisvorschaurechnung
Zielsetzung	<ul style="list-style-type: none">• In der Schulung wird die prozessbezogene Umsetzung in der Anwendung sDIS OSPlus vermittelt• Die Teilnehmer/-innen können Portfolios und Portfoliohierarchien zur Strukturierung ihres Zinsbuches sowie Szenarien und Szenariobündel definieren• Sie können Simulationsparameter anlegen und Standardsimulationen zur wertorientierten Zinsbuchsteuerung ausführen• Die Anlage von Benchmarks und Maßnahmen sowie die Simulationsergebnisse und deren Verwendung in einem Report werden besprochen• Auf die Marktdatenversorgung in EINSTAND wird eingegangen

Inhalte

- Überblick über den monatlichen Regelprozess
- Wiederholung zur Datenversorgung
 - Anlieferung und Verwaltung von Marktdaten in EINSTAND
 - Datenanlieferung aus SCD
 - Export und Übernahme der Cash-Flows aus CASHVER
 - Zusatz-Cash-Flows (z.B. für Spezialfonds)
- Institutseinstellungen in sDIS OSPlus
- Arbeiten mit Gattungen und Skontren
- Freie Attribute
- Portfoliokonfiguration und –hierarchie
- Zins- und andere Marktdatenszenarien
- Ermittlung ausgewählter wertorientierter Kennzahlen (Simulationsparameter, Ausführung und Ergebnissichten)
 - Barwert- und Prognosewertsimulation
 - BaFin-Zinsschock und Stressszenarien
 - Moderne Historische Simulation (MHS) zur Ermittlung des VaR
 - Ex-post Performance
 - Exportmöglichkeiten der Simulationsergebnisse und Aufbau eines Risikoreports
- Limitierung und Steuerung des wertorientierten Zinsänderungsrisikos

- Benchmarks
- Maßnahmen

Voraussetzungen	Der Besuch der Veranstaltung „ Anwenderschulung zur Datenhaltung und Datenabstimmung mit CASHVER, sDIS OSPlus und Portal msgGillardon “ (05.202.90.02) ist vorteilhaft aber nicht zwingend erforderlich
Hinweis	<p>Während der Schulung wird auf das Echtssystem per Token zugegriffen. Hierzu ist es zwingend erforderlich, dass die Teilnehmer/-Innen einen Token (SEVA-Token mit der Berechtigung TSR) der Sparkasse inkl. der Zugangskennungen mitbringen.</p> <p>Außerdem müssen die Teilnehmer/-Innen ihren Benutzernamen und das Passwort mitbringen.</p> <p>Andere Anmeldeverfahren (wie z.B. Single Sign On, Chipkarte oder Fingerabdruck) müssen für die Dauer der Schulung umgestellt werden.</p> <p>Da für einen Zugriff auf das Echtssystem mittels SEVA entsprechende Anweisungen gelten, stimmen Sie bitte die weitere Organisation und Bereitstellung der Token mit Ihrer IT-Orga ab.</p> <p>Bitte klären Sie dies ggf. mit Ihrem Datenschutzbeauftragten ab.</p> <p>Die Veranstaltung wird in Kooperation mit der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen angeboten.</p> <p>Bitte melden Sie Ihre Teilnehmer/-innen für dieses Seminar direkt bei der Sparkassenakademie Hessen-Thüringen an.</p> <p>Sparkassenakademie Hessen-Thüringen</p>
Meldeschluss	Montag, den 30.09.2019