



Fokus ökonomische RTF und Barwert(see)



Endlich die neue RTF verstehen

Online-Seminar

26. Juli 2023

REFERENT



Roland Eller
Geschäftsführer,
Roland Eller Consulting GmbH

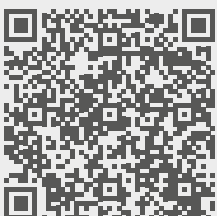
Als Trainer und Berater begeistert er mit vielen anschaulichen Beispielen und aktivem Einbeziehen seine Zuhörer.

VORTEILE

- ✓ Sie entwickeln ein besseres Verständnis für Barwerte, Value-at-Risk, Korrelationen bzw. Kovarianzen und Volatilitäten.
- ✓ Sie lernen, die Monte Carlo Simulation, den Varianz-Kovarianz-Ansatz und die Historische Simulation zu interpretieren.
- ✓ Sie werden Chancen und Risiken Ihres Institutes besser steuern können.

INFOS

- Online-Seminar für Vorstände, Controller, Treasurer, Führungskräfte aus dem Markt und Revisoren
- Teilnehmer erhalten ein Teilnahmezertifikat
- **Kosten: 310 € zzgl. MwSt., für ERFA-Mitglieder 280 € zzgl. MwSt.**
- bis eine Woche vorher kostenlos stornierbar
- **Anmeldung bis 24. Juli 2023 mit Betreff „Fokus Barwert“ per E-mail: dorothea.hill@rolandeller.de oder online**
- Anmelde-link zum Webinar nach erfolgter Anmeldung



Jetzt anmelden

AGENDA

09.00 – 11.30 Uhr

Roland Eller

Grundlagen der ökonomischen Perspektive

- Warum die ökonomische Perspektive sinnvoll ist?
- Den statischen Kennzahlen einen Sinn geben: Von der Volatilität bis zur Korrelation
- Wechselwirkungen zwischen normativer und ökonomischer Perspektive

Barwertige Risikodeckungsmassen

- Der Barwertsee als Basis für die ökonomische Perspektive
- Die Herleitung der ökonomischen Risikodeckungsmasse und mögliche Fallstricke

Die Risikomessung in der ökonomischen Perspektive

- Interpretation der VaR-Werte und die dahinterstehenden geschäftspolitischen Aussagen
- Korrelationen bei der Risikoaggregation – Auf was ist zu achten?
- Verlustfreie Bewertung des Zinsbuches (BFA 3) und die Implikationen für die ökonomische Perspektive
- Die Erwartungen der Aufseher an die ökonomische Perspektive

Die Steuerung und Optimierung in der ökonomischen Perspektive

- Das Zinsbuch im Fokus: Benchmarking und Cash-Flow-orientierte Steuerung – Lehren aus 2022
- Die Optimierung der Asset Allocation (Kundengeschäft und Treasury) – Fallbeispiele aus der Praxis

Fazit und Ausblick

Programmänderungen aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

„Wir danken Herrn Eller für klare, einfache Worte, die im Zusammenhang mit dem sehr komplexen Sachverhalt erfreulich gut verständlich und hilfreich für die eigene Interpretation waren.“

Axel Sippel

Vorstandsvorsitzender Sparkasse Iserlohn