



vps.epas

Risikomanagement im aktuellen Umfeld: Ist Ihre Kasse auf den «Nach-Corona-Markt» vorbereitet?

Ein Praktiker-Workshop für Mitglieder
von Anlagekommissionen
und Führungsorgane, die sich mit
Anlagefragen befassen

Donnerstag, 25. März 2021

**Online-Workshop auf der
vps.epas-Lernplattform**

Infos und
Anmeldung unter
vps.epas.ch

**Risiken müssen identifiziert und überwacht werden.
Aber wie werden sie in den Führungsprozess integriert,
insbesondere während turbulenten Börsenzeiten?
Der Workshop behandelt die Integration des
Risikomanagements in die Steuerung der VE und
die Analyse der verschiedenen Ansätze.**

Der Vertiefungstag richtet sich ausschliesslich an Mitglieder von Anlageausschüssen von Pensionskassen und Stiftungen, die sich mit der Überwachung der Anlageprozesse beschäftigen und neue Anlageideen zur Entscheidungsfähigkeit bringen. Für den Besuch dieses Kurses wird praktische Erfahrung und/oder der Besuch des Modulkurses «Einführung in die berufliche Vorsorge» vorausgesetzt.

Inhalt

Grundlagen

Was verstehen OAK und Finma unter Risikomanagement? Wie definiert sich Compliance Monitoring, Risikokontrolle und Risikomanagement? Welchen Stellenwert hat ein Anlagereglement? Aufbau- und Ablauforganisation im Anlagereglement, Umfang des Risikomanagements, Arbeitsteilung Stiftungsrat/Anlageausschuss.

Risikomanagement im aktuellen Umfeld

Die Erfahrungen im vergangenen Jahr haben bei verschiedenen Kassen offene Fragen aufgedeckt. Das waren zum Beispiel:

- In den Modellen wurde von einer Diversifikation ausgegangen, die in der Krise nicht mehr existierte
- Hatten die alternativen Anlagen tatsächlich ein alternatives Volatilitäts-Muster?
- Hatten die Vorsorgeeinrichtungen Reaktionsmechanismen und -abläufe, die dem Tempo der Ereignisse angepasst waren?

Integration des Risikomanagements in die Steuerung der Vorsorgeeinrichtung

Relativ robuste, reaktive Risikomanagement-Systeme mit strategischen Beschränkungen der Währungsrisiken, engen taktischen Bandbreiten und mechanischen Umschichtungen haben sich als miliztauglich erwiesen. In der Krise zeigte sich aber, dass in der in turbulenten Zeiten mit alternativen Modellen gearbeitet wird.

In der Praxis wurden verschiedene Risikomodelle angewandt. So gab es zum Beispiel das Modell des Deckungsgradschutzes, das Modell, dass man den «Autopiloten» ausschaltete und auf Handsteuerung überging, und es gab die Modelle des mechanischen

Rebalancing. Anhand von praktischen Beispielen wird geprüft, wie sich die verschiedenen Ansätze im Corona-Jahr bewährt haben. Ergänzend dazu werden auch neue Modellansätze aus England und Kanada unter die Lupe genommen.

Die Veranstaltung wird als Online-Workshop durchgeführt. Neben Impulsreferaten im Plenum erhalten die Teilnehmenden Gelegenheit, in kleineren Gruppen die verschiedenen Ansätze zu diskutieren und zu vergleichen.

Referenten

Marco Bagutti, Leiter Kapitalanlagen,
Stiftung Auffangeinrichtung BVG

Christian Heiniger, Retirement Services
Switzerland, Willis Towers Watson

Jürg Schiller, VI Vorsorgeinvest AG

Die Veranstaltung wird online auf der vps.epas-Lernplattform durchgeführt

Zeit

13.30 – 18.00 Uhr

Kosten

Fr. 710.– pro Teilnehmer/in

Für Abonnenten der «Schweizer Personalvorsorge»:

Fr. 660.– pro Teilnehmer/in

Preise inkl. digitale Unterlagen und Weiterbildungs-Zertifikat

AGB: vps.epas.ch

Credit Points

Berufliche Vorsorge: 6.5 CP

Cicero: 5 CP

CFA Institute: 3.5 CE Credits, wovon 1 SER

Anmeldung unter vps.epas.ch

Auskünfte

Simone Ochsenbein, +41 (0)41 317 07 23, so@vps.epas.ch

VPS Verlag Personalvorsorge und Sozialversicherung AG, Postfach 4242, CH-6002 Luzern

vps.epas.ch

Credit Points

