

Ständige Weiterbildung



Risikomanagement im aktuellen Umfeld

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

**Donnerstag, 25. März 2021
Zürich**

Risiken müssen identifiziert und überwacht werden. Aber wie werden sie in den Führungsprozess integriert? 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

Tiefe Zinsen erhöhen die Anlagerisiken und verringern die Diversifikationseigenschaften. Wie geht man mit Indexveränderungen und Indexauswahl um? Wie werden Risikobudgets festgelegt und überwacht? Wie kann man zusätzliche Diversifikationsvorteile erschliessen und neue Anlageideen integrieren?

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. Gibt es Alternativen zu diesem Ansatz? Zum Beispiel deckungsgradabhängiges Anlegen? Welche Voraussetzungen müssen für neue Ansätze geschaffen werden?

Referenten

Marco Bagutti, Leiter Kapitalanlagen,
Stiftung Auffangeinrichtung BVG

Christian Heiniger, Retirement Services Switzerland,
Willis Towers Watson

Jürg Schiller, VI Vorsorgeinvest AG

Ort

Four Points by Sheraton Sihlcity
Zürich, Kalandergasse 1, 8045 Zürich

Zeit

13.30 – 18.00 Uhr

Kosten

Fr. 710.– pro Teilnehmer/in

Für Abonnenten der «Schweizer
Personalvorsorge»:

Fr. 660.– pro Teilnehmer/in

Preise inkl. Unterlagen,
Weiterbildungs-Zertifikat und
Pausenerfrischungen

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.epas.ch

Credit Points

