



vps.epas

Afternoon-Series

Ausbildungszyklus «Pension Assets»:
Vermögensbewirtschaftung
für Verantwortliche der 2. Säule

31. August / 7. / 14. September 2023
Zürich

Infos und
Anmeldung unter
vps.epas.ch

Mit dem Ausbildungszyklus erhalten die Teilnehmenden ein aktualisiertes Wissen in Sachen Vermögensbewirtschaftung, kennen die Wirkungsweisen und das Zusammenspiel der Anlagen, stellen die wichtigen Fragen zur Aktivseite einer Pensionskasse und können eine Anlagestrategie auf ihre Plausibilität beurteilen. Der interaktiv geleitete Workshop unterstützt Sie in Fragen zum Asset Management.

Unsere «Afternoon-Series» richten sich an Verantwortliche der 2. Säule, die sich mit Anlagefragen befassen. Dies sind Geschäftsführer und Anlageverantwortliche als wichtigste operative Schnittstelle, Pensionskassenexperten, die sich neben den Verpflichtungen auch mit den Anlagen befassen müssen und natürlich strategische Führungsorgane, die ihr Grundwissen aktualisieren möchten.

Afternoon 1

Donnerstag, 31. August 2023

Grundwissen, «Basics»

Einführung; Aufbauorganisation einer Pensionskasse; Governance/Gewaltentrennung und Investment; Prinzipien der Vermögensanlagen einer PK; Kriterien für Auswahl von Kapitalanlagen; Bewertung von Kapitalanlagen; Taktisches oder regelbasiertes Bilanzmanagement; Aktives und passives Management; Wrap-up und Summary

Stefan Beiner, Leiter Asset Management,
stv. Direktor Pensionskasse des Bunds PUBLICA

Adrian Wipf, Leiter Asset Management,
Mitglied GL BVK

Risk Management

Relevante Risiken; Messung der Risiken; Sinnvolle Kennzahlen; Steuerung der Risiken; Overlay/Fallstricke

Heinrich Flückiger, Senior Consultant Prevanto AG

Markus Hübscher, Geschäftsführer MoreB

Afternoon 2

Donnerstag, 7. September 2023

Asset-Liability-Management

Erwartete Renditen und weitere Input-Parameter; Finanzielle und strukturelle Risikofähigkeit (inkl. Rolle Arbeitgeber); Einfluss der Sollrendite/ Risikotreiber; Risikobemessung unter Beachtung der Verpflichtungen; Risikobudgetierung; Strategierisiko vs. Umsetzungsrisiko; Pitfalls (z.B. Optimierer, Modellgläubigkeit, Abhängigkeit Input-Parameter); Beispiel aus der Praxis

Marco Jost, Partner PPCmetrics AG

Martin Wagner, CEO Pensionskasse der
Credit Suisse Group (Schweiz)

Anlageprozess konkret

Ausgestaltung des Anlageprozesses in der Praxis: Anlageorganisation, Anlagestrategie, Anlagetaktik und Umsetzung; Anlageorganisation: Etablierung einer effizienten Anlageorganisation; Anlagestrategie: Risikobudget, Prognose- und Allokationsansätze sowie Benchmarkselektion; Anlagetaktik: Rebalancing vs. aktive Allokationssteuerung; Umsetzung: Titelselektion und Managerselektion sowie opportunistische Investments im aktuellen Marktumfeld; Vereinigung von Praktiker- und Consultant-Sicht

Andreas Dänzer, Chief Investment Officer,
Pensionskasse der Credit Suisse Group (Schweiz)

Ueli Mettler, Partner c-alm AG

Afternoon 3

Donnerstag, 14. September 2023

Anlagereporting

Inhalt und Umfang des Anlagereportings, auch in Funktion der Anlageinstrumente; Periodizität; Empfängerkreis; Interpretation der Resultate: Interventionen? Daraus abgeleitet auch Fragen der Organisation, Governance

Christoph Oeschger, CEO Avadis

Silvia Rudigier, Partner PPCmetrics AG

Alternative Anlagen

Abgrenzung, Risikoprämien, Rolle Gesamtportfolio; wichtigste Alternative Anlageklassen: Private Equity, Private Debt, Insurance Linked Securities, Hedge Funds, Commodities, Vergleich der Risikoprämien, Liquidität und Kosten; Abgrenzung gemäss BVV 2;

Christoph Gort, Partner SIGLO Capital Advisors AG

Georg Wessling, F. Hoffmann-La Roche AG, PhD,
Senior Portfolio Manager Alternative Investments

Ort

Glockenhof Zürich, Sihlstrasse 31, 8001 Zürich

Zeit

Ganzer Kurs: 3 Nachmittage mit 6 Themenblöcken, jeweils 13.30 – 19.00 Uhr

Kosten

Fr. 1920.– pro Teilnehmer (Einzeltage Fr. 710.–)

Spezialpreis

Für Abonnenten der «Schweizer Personalvorsorge», Mitglieder SKPE und Mitglieder VVP:
Fr. 1710.– pro Teilnehmerin (Einzeltage Fr. 660.–)

Preise inkl. digitale Unterlagen, Weiterbildungs-Zertifikat und Pausenerfrischungen

AGB: vps.epas.ch

Credit Points pro Afternoon

Berufliche Vorsorge: 6 CP (total 18)

CFA Society Switzerland: 4.5 CE Credits (total 13.5)

Cicero: 6 CP (total 18)

Mitglieder SAV: 3 CP (total 9)

Mitglieder SKPE: 3 CP (total 9)

Anmeldung unter vps.epas.ch**Auskünfte**

Beatrice Steiner, +41 (0)41 317 07 48, bs@vps.epas.ch

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

vps.epas.ch

Partner/Credit Points