

# Risikomanagement im aktuellen Umfeld

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

**Mittwoch, 22. März 2023**  
**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 Entscheidung bringen. Für den Besuch dieses Kurses wird praktische Erfahrung und/oder der Besuch des Modulkurses «Einführung in die berufliche Vorsorge» vorausgesetzt.

## Inhalt und Referenten

### **Grundlagen**

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

### **Risikomanagement im aktuellen Umfeld**

Volatile 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?

Marco Bagutti, Leiter Kapitalanlagen, Stiftung

Auffangeinrichtung BVG

Christian Heiniger, Retirement Services Switzerland,

Willis Towers Watson

Jürg Schiller, CFA, VI Vorsorgeinvest AG

Weitere Informationen finden Sie unter [vps.epas.ch](https://vps.epas.ch).  
Programmänderungen vorbehalten.

### **Ort**

Hotel Glockenhof  
Sihlstrasse 31, 8001 Zürich

### **Zeit**

13.30 – 18.00 Uhr

### **Kosten**

Fr. 710.– pro Teilnehmer

### *Spezialpreise*

Für Abonnenten der «Schweizer Personalvorsorge»:

Fr. 660.– pro Teilnehmerin

Preise inkl. digitale Unterlagen, Weiterbildungs-Zertifikat und Pausenerfrischungen

AGB: [vps.epas.ch](https://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](https://vps.epas.ch)**

### **Auskünfte**

Simone Ochsenbein

+41 (0)41 317 07 23

[so@vps.epas.ch](mailto:so@vps.epas.ch)

[vps.epas.ch](https://vps.epas.ch)

Credit Points

