

Warum die verschärften Eigenkapitalanforderungen an Banken und Sparkassen nicht zwangsläufig zu einer Verschlechterung der Ertragslage führen müssen!



Depot A-Analyse: Heben von Ergebnispotenzialen in der Asset Allokation

Modul 2: Verbesserung der Rendite-Risiko-Relation durch Vermögensallokation • Vorgaben und ESG im Allokationsprozess • Einfluss von Sachanlagen und Volatilitätsstrategien

Mit diesem und weiteren Seminaren können Sie auch ein Zertifikat erwerben, alle Infos finden Sie hier: [Zertifizierter Spezialist Depot A \(FCH\), SE2411006, 11.11.2024 - 14.11.2024](#)

10:00 - 13:00 Uhr

Swen Kaiser

Bereich Treasury
Volksbank Mittelhessen eG

U.a. Dozent im Fach
Portfoliomanagement und Autor von
Fachartikeln.

- Auswirkungen der **langjährigen Niedrigzinspolitik**, verschärften **Kapitalanforderungen** und der **steigenden Zinsen** auf die aktuelle **Ertragslage** von (LSI-)Instituten: u.a. Erweiterung des **Investmentspektrums** (z.B. um grüne Kapitalanlagen und Infrastrukturprojekte) • Aufbau eines **Rendite-/Risiko-optimierten** Portfolios
- Regulatorische Vorgaben zur **Vermögensallokation**: Vorhalten hochliquider, eigenmittelschonender Anlageklassen (**HQLA**) • Optimierung der risikogewichteten Aktiva (**RWA**) • (neuartige) **Nachhaltigkeitsfaktoren**
- **Erweiterung** der Vermögensallokation um **illiquide Anlageklassen** (als „Buy and Hold-Investments“) zum **Ausgleich** der **Rendite-Nachteile** des regulatorischen Portfolios und zur Nutzung von Korrelationsvorteilen
- Notwendigkeit weniger konjunktursensitiver Anlagen des **illiquiden Langfristportfolios** – Immobilienfonds, Infrastrukturanlagen und erneuerbare Energien (EE) als **stabile Ertragsbringer** in Krisenzeiten
- Herausforderungen bei der **Zusammenstellung** der einzelnen **Assetklassen**: u.a. **reale Investierbarkeit** und **historische Zeitreihen** zur Validierung von Rendite, Risiko und Diversifikationsbeitrag
- **Kritische Überprüfung** der Vermögensallokation im **Portfoliomanagement-Prozess**: u.a. Zielerreichung bei strategischer und taktischer **Asset Allokation** • Begründung für **aktives Abweichen** von der Benchmark • worauf ist bei **Performance-Analysen** zu achten? • Überprüfung der Anlagepolitik im Rahmen der Portfoliooptimierung

(dazwischen 15 min. Pause)

Depot A-Analyse: Heben von Ergebnispotenzialen in der Asset Allokation

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Depot A-Analyse: Heben von Ergebnispotenzialen in der Asset Allokation



12.11.2024 (SE2411008)

399,00 €*

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	339,15 €
Treue PLUS 20	319,20 €
Treue PLUS 25	299,25 €

Wenn Sie eine individuelle Beratung zum Thema benötigen, unterstützen wir Sie gerne, klicken Sie hier: <https://www.fch-gruppe.de/consult>



Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen.

Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

Ich kann nicht am Seminar teilnehmen und bestelle deshalb die Seminarunterlagen als PDF zu den oben angekreuzten Seminaren (150,00 € *** je Seminardokumentation)

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:
(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Zeitgleich mit den steigenden Zinserträgen nehmen Emittenten-, Kontrahenten-, Credit Spread- u.a. Risiken im Depot A und die bankenaufsichtliche Anforderungen stetig zu. Vor dem Hintergrund gewinnt die (Stärkung der) Eigenkapitalbasis und die immer wichtiger werdenden Nachhaltigkeitsfaktoren im Rahmen der Vermögensallokation weiter an Bedeutung. Als Reaktion auf das unsichere Marktumfeld der zurückliegenden Jahre haben viele (auch LSI-)Institute damit begonnen, ihr Investmentuniversum sukzessive zu erweitern. Hierbei wird der Aufbau eines Portfolios aus niedrig korrelierten Assetklassen angestrebt, das den investierten Wert sichert, Erträge geniert und gleichzeitig die (neuartigen) Risiken minimiert. Ein erfahrener Bankpraktiker gibt wertvolle Praxisempfehlungen zur Optimierung der Vermögensallokation zwischen Rendite, Risiko und Nachhaltigkeit.

12.11.2024 10:00 bis 13:00 Uhr

Der Zugang zum Seminar erfolgt über Ihren persönlichen Nutzerbereich in „MeinFCH“. Informationen zum Zugang und eine Anleitung erhalten Sie spätestens eine Woche vor dem Seminar. Ihre Teilnahmebestätigung und die Seminardokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei zeitgleicher Anmeldung einen Rabatt von 20%.

Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung Ihre Anmeldebestätigung/Rechnung. Bitte überweisen Sie den Rechnungsbetrag innerhalb von 30 Tagen nach Zugang der Rechnung.

Eine Stornierung Ihrer Anmeldung ist nicht möglich. Eine kostenfreie Vertretung durch Ersatzteilnehmer beim gebuchten Termin dagegen schon. Der Name des Ersatzteilnehmers muss dem Veranstalter jedoch spätestens vor Seminarbeginn mitgeteilt werden. Wir weisen darauf hin, dass „Teilnahmen“ von anderen als den gebuchten Teilnehmern nicht gestattet sind und Schadensersatzansprüche des Veranstalters auslösen. Filmmitschnitt

Bei Absage durch den Veranstalter wird das volle Seminarentgelt erstattet. Darüber hinaus bestehen keine Ansprüche. Änderungen des Programms aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

Durch die Teilnahme am Seminar erhalten Sie 4 CPE-Punkte als Weiterbildungsnachweis für Ihre Zertifizierung

* zzgl. 19 % MwSt. ** inkl. 7 % MwSt. *** zzgl. 7 % MwSt.

Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die FCH AG und ihre Dienstleister (z. B. Lettershop) verwenden Ihre personenbezogenen Daten für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen ausgewählte Fach- und Produktinformationen per Post zukommen zu lassen. Sie können der Verwendung Ihrer Daten jederzeit durch eine Mitteilung per Post, E-Mail oder Telefon widersprechen.

Senden Sie mir bitte Fach- und Produktinformationen sowie die Banken-Times SPEZIAL für meinen Fachbereich kostenfrei an meine angegebene E-Mail Adresse (Abbestellung jederzeit möglich).

Senden Sie uns Ihre Bestellung per Mail an: info@fch-gruppe.de

oder schriftlich an:

FCH AG
Im Bosseldorn 30, 69126 Heidelberg
Fax: +49 6221 99898-99

Weitere Informationen erhalten Sie unter:

+49 6221 99898-0
oder unter www.FCH-Gruppe.de

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen

Anmelden / Bestellen