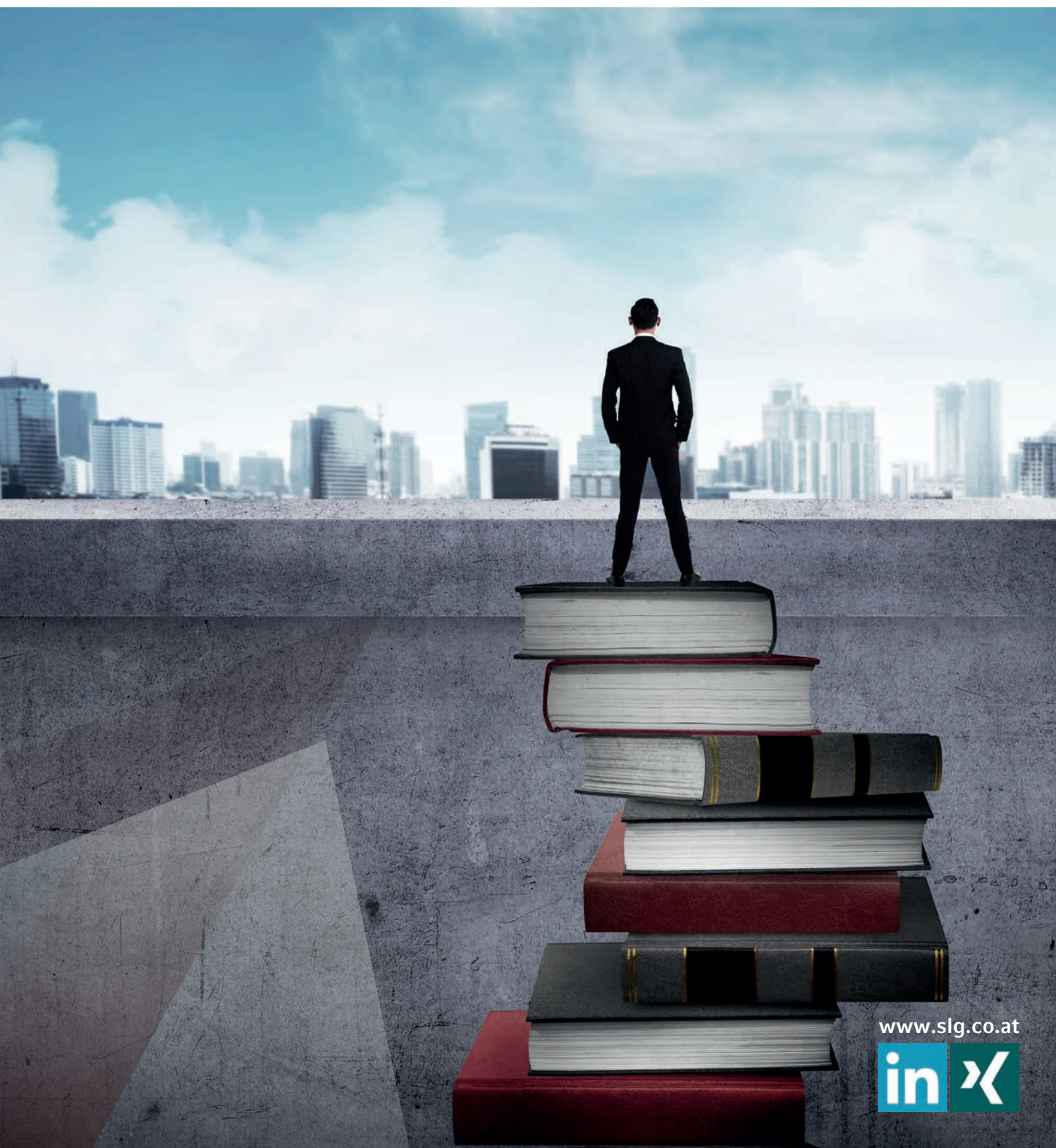




SCHWABE, LEY & GREINER

# PROFESSIONELLER UMGANG MIT FINANZRISIKEN

---



[www.slg.co.at](http://www.slg.co.at)



## ÜBERSICHT

## TERMINE

14.-16. Mai 2019 (Mannheim)

## SEMINARZEITEN

Tag 1 – 10:00 bis 18:00 Uhr

Tag 2 – 09:00 bis 17:00 Uhr

Tag 3 – 09:00 bis 13:00 Uhr *(Optional)*

## TEILNAHMEGEBÜHR

EUR 1.950,- zzgl. USt. (2 Tage)

EUR 2.250,- zzgl. USt. (3 Tage)

## REFERENT

Bernhard Kastner

Manager bei Schwabe, Ley & Greiner



Bernhard Kastner ist seit 2008 bei SLG in der Abteilung „Marktrisiko-Management“ tätig. Zu seinen Aufgaben zählen die Beratung in den Bereichen Corporate

Finance und Risiko-Management sowie die Analyse und Bewertung von derivativen Finanzinstrumenten. Herr Kastner verfügt über reichhaltige Projekterfahrung in der Quantifizierung von Wechselkursrisiko, im Zinsrisiko-Management und in der Portfolio-Analyse.

Bernhard Kastner trägt bei SLG-Seminaren zu den Themen Risiko-Management, Finanzmathematik und Bewertung von Derivaten vor.

## PROFESSIONELLER UMGANG mit FINANZRISIKEN

### Von der Exposure-Identifizierung bis hin zum Reporting

#### Inhalt

Ein professionelles Risiko-Management ist sowohl für Großunternehmen als auch für Mittelständler von Bedeutung und umsetzbar, unabhängig von ihrer Größe. Das Seminar beschäftigt sich damit, wie man die Positionen für Finanzrisiken ermittelt und daraus Risiken darstellt und interpretiert. Anschließend gilt es zu entscheiden, ob und wie Risiken zu sichern sind. Ein aussagekräftiges Reporting rundet das Risiko-Management ab.

Wie das Risiko in Excel berechnet wird, können Sie in einem zusätzlichen optionalen Modul (Halbtag) lernen.

#### Themenschwerpunkte

- ▲ Exposure – Was ist überhaupt „im Risiko“?
- ▲ Measure – Wie misst man Risiko?
- ▲ Capacity – Wieviel ist „viel“ und wieviel Risiko könnten wir tragen?
- ▲ Strategy – Wie steuert man Risiko?
- ▲ Limits – Wie wird Risiko wirksam begrenzt?
- ▲ Reporting – Was muss wie berichtet werden?
- ▲ Calculation – Wie rechnet man Risiko? (optional)

#### Teilnehmerkreis

Das Seminar richtet sich an Mitarbeiter und Führungskräfte aus dem Finanz- und Treasury-Bereich und an Kundenbetreuer aus Banken, die das Tagesgeschäft ihrer Kunden besser verstehen wollen. Basiswissen im Risiko-Management wird empfohlen.

#### Ziele 1/2

##### 1. Exposure

- ▲ Welche Daten im Unternehmen können für die Ermittlung des Exposures dienen?
- ▲ Welche Positionen (gebuchte, IC etc.) sind für die Exposure-Ermittlung für Währungs- und Zinsrisiko relevant?
- ▲ Wie wirken sich Preislisten und Projektgeschäft auf das Risiko-Exposure aus?

##### 2. Measure

- ▲ Mit welchen Methoden kann Risiko gemessen werden?
- ▲ Was kann eine Sensitivitätsanalyse, was ein Value-at-Risk?
- ▲ Was ist der Unterschied zwischen Value-at-Risk und Cash-flow-at-Risk?
- ▲ Was bringt ein Stress-Test und wie kann er durchgeführt werden?

##### 3. Capacity

- ▲ Wie kann eine Risikokapazität hergeleitet werden?
- ▲ Wie können Ratings und Covenants als Maßstäbe genutzt werden?
- ▲ Was ist der Unterschied zwischen Risikokapazität und Risikoappetit?

## SCHWABE, LEY & GREINER

Rund 50 Mitarbeiter und mehr als 5.000 Projekte bei über 2.000 Kunden – seit 1988 sind wir das führende Beratungsunternehmen im deutschsprachigen Raum mit Spezialisierung auf das Finanz- und Treasury-Management in Unternehmen.

### Ziele 2/2

#### 4. Strategy

- ▲ Wie kommt man vom Risikoappetit zur Strategie?
- ▲ Wie nutzt man Diversifizierung in der Festlegung der Risikostrategie?
- ▲ Wie wirken sich verschiedene Sicherungsstrategien auf das Risiko aus?

#### 5. Limits

- ▲ Was sind Positions-, Verlust- und Risikolimits?
- ▲ Wie können verschiedene Limits festgelegt werden?
- ▲ Wie wird die Ausnutzung von Limits ermittelt und welche Berücksichtigung finden dabei realisierte und unrealisierte Gewinne oder Verluste?

#### 6. Reporting

- ▲ Welche Inhalte sind in einem aussagekräftigen Bericht nötig?
- ▲ Wie kann Risiko-Exposure und Risiko dargestellt werden?
- ▲ Welche Schlussfolgerungen können aus Risikoberichten gezogen werden?
- ▲ Wie kann die Treasury-Performance gemessen werden?

#### 7. Calculation in Excel (optional)

- ▲ Wie berechnet man Volatilitäten und Korrelationen aus Marktdaten?
- ▲ Wie ermittelt man einen Value- und Cashflow-at-Risk?
- ▲ Wie errechnet sich ein Component-VaR?

### SLG-Seminare beispielgebend

Alle Seminare von Schwabe, Ley & Greiner sind in jeder Hinsicht „beispielgebend“, weil sie unmittelbar auf unserer Beratungspraxis aufbauen. Somit gehen sie direkt auf die Aufgabenstellungen des Treasury-Alltags ein. Traditionell empfehlen über 90 % der Seminarteilnehmer die von ihnen besuchte Veranstaltung weiter!

### Themenverwandte Seminare

- ▲ **Derivative Instrumente**  
Derivative Währungs- und Zinsinstrumente rechnen und einsetzen
- ▲ **Währungs- und Zinsrisiko-Management**  
Risikopotenziale erkennen, limitieren und steuern

Weitere Seminare und Lehrgänge finden Sie auf unserer Website [www.slg.co.at](http://www.slg.co.at) unter der Rubrik „Ausbildung“.





## ANMELDUNG

Melden Sie sich einfach und bequem über das Onlineformular auf unserer Website [www.slg.co.at](http://www.slg.co.at) unter der Rubrik Ausbildung an.

## ORGANISATORISCHES

Das Team von Schwabe, Ley & Greiner steht Ihnen während der gesamten Vorbereitung sehr gerne zur Verfügung.

✉ [info@slg.co.at](mailto:info@slg.co.at)

☎ +43-1-5854830

## Teilnahmegebühr

Die Preise verstehen sich zzgl. USt., inklusive Unterlagen, Mittagessen, Getränken. Wir behalten uns etwaige Preisänderungen vor. Ein „Frühbucherbonus“ (s. u.) gilt nur bei Zahlung der Rechnung laut Zahlungsbedingungen.

## Frühbucherbonus

Wenn Sie sich mindestens 60 Tage vor Veranstaltungsbeginn anmelden, gewähren wir einen Frühbucherbonus von 15 % auf den Nettopreis. Hinweis: Der Frühbucherbonus kann nur für Seminare gewährt werden. Der Frühbucherbonus wird nicht gewährt für: Lehrgänge, Symposien und Roundtables.

## Stornierung

Ein Rücktritt von der Teilnahme muss vor Beginn der Veranstaltung in Schriftform erfolgen. Eine Stornierung der Anmeldung ist bis 30 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenlos möglich, danach werden 50 % der Teilnahmegebühr in Rechnung gestellt. Bei Stornierung am Veranstaltungstag oder Nichterscheinen wird die gesamte Seminargebühr fällig. Selbstverständlich können Sie eine Ersatzperson entsenden oder eine Umbuchung vornehmen.

Bei Absage durch SLG wird die bereits bezahlte Teilnahmegebühr zurückerstattet. Weitergehende Ansprüche sind ausgeschlossen.

## Förderungen für Seminare

Zahlreiche Institutionen bieten Unternehmen Fördermittel zur Weiterbildung ihrer Mitarbeiter an. Unser Tipp: Sprechen Sie mit Ihrer Personalabteilung oder nehmen Sie Kontakt mit der für Sie zuständigen Wirtschafts- oder Handelskammer auf.

## Veranstalter

### **Schwabe, Ley & Greiner Gesellschaft m.b.H.**

Gertrude-Fröhlich-Sandner-Straße 3, 1100 Wien, Österreich  
Handelsgericht Wien – UID ATU16105408 – FN 59336i

### **Schwabe, Ley & Greiner (Deutschland) GmbH**

Schumannstraße 27, 60325 Frankfurt am Main, Deutschland  
Amtsgericht Frankfurt am Main – UID DE188158868 – HRB 43454