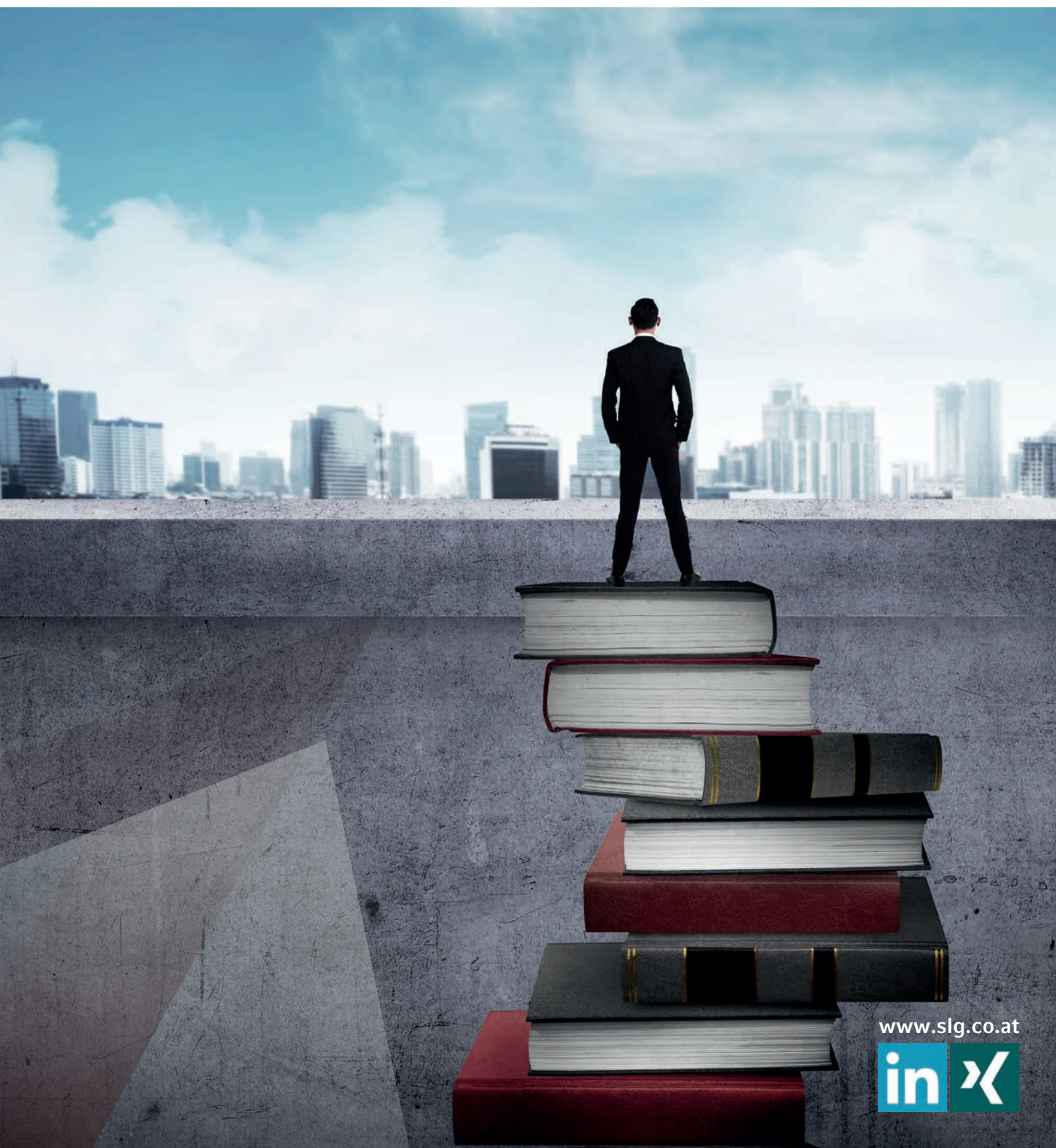




SCHWABE, LEY & GREINER

WÄHRUNGS- UND ZINSRISIKO- MANAGEMENT



www.slg.co.at



ÜBERSICHT

TERMINE

26.-28. März 2019 (Wien)
 25.-27. Juni 2019 (Mannheim)
 29.-31. Oktober 2019 (Wien)
 3.-5. Dezember 2019 (Mannheim)

SEMINARZEITEN

Tag 1 – Währungsrisiko-Management
 10:00 bis 18:00 Uhr

Tag 2 – Währungsrisiko-Management
 09:00 bis 12:30 Uhr

Tag 2 – Zinsrisiko-Management
 13:30 bis 17:00 Uhr

Tag 3 – Zinsrisiko-Management
 09:00 bis 17:00 Uhr

TEILNAHMEGEBÜHR

Modul 1 **und** 2
 EUR 2.400,- zzgl. USt.

Modul 1 **oder** 2
 EUR 1.700,- zzgl. USt.

REFERENT – Währungsrisiko-Management



Thomas Schörner
 Partner bei
 Schwabe, Ley & Greiner

REFERENT – Zinsrisiko-Management



Günther Bauer
 Partner bei
 Schwabe, Ley & Greiner



alternativ:
 Peter Schmid
 Senior Berater bei
 Schwabe, Ley & Greiner

WÄHRUNGS- UND ZINSRISIKO-MANAGEMENT

Risikopotenziale erkennen, limitieren und steuern

Inhalte

Währungs- und Zinsschwankungen können für Unternehmen wie für Banken erhebliche Ergebnisvolatilität verursachen. Dadurch wird nachweislich der Unternehmenswert negativ beeinflusst, zum Teil sogar der Fortbestand in Frage gestellt.

Im Zuge des Seminars wird der Prozess des Marktrisiko-Managements strukturiert aufbereitet. Dabei wird identifiziert, welche Positionen risikobehaftet sind, und analysiert, wie die Risiken auf das Unternehmen wirken. Unterschiedliche Quantifizierungsmethoden werden vorgestellt und die Vor- und Nachteile ausführlich besprochen. All diese Informationen erlauben es, fundierte Entscheidungen zur Risikostrategie zu fällen und in weiterer Folge zu implementieren.

Die potenzielle Bedeutung dieser Risiken verlangt eine sorgfältige Steuerung. Nicht nur auf Grund von gesetzlichen Vorgaben sondern vielmehr auch im Rahmen einer nachhaltigen Unternehmenssteuerung (Stichwort: Compliance).

Themenschwerpunkte

Modul Währungsrisiko-Management (1,5 Tage)

- ▲ Erscheinungsformen des Risikos – direktes und indirektes Währungsrisiko
- ▲ Risikoanalyse
- ▲ Quantifizierung anhand von Volatilitäten
- ▲ Ansätze für die Risikostrategie und Bausteine einer Risikopolitik
- ▲ Absicherungsinstrumente im praktischen Einsatz: Termingeschäfte, Optionen
- ▲ Grundzüge der Bilanzierung derivativer Instrumente
- ▲ Fallbeispiele

Modul Zinsrisiko-Management (1,5 Tage)

- ▲ Quellen und Erscheinungsformen des Risikos
- ▲ Methoden zur Risikomessung: Sensitivitäts- und At-Risk-Analysen
- ▲ Ansätze zur Zinsrisiko-Strategie: Kosten- und Risikoaspekte
- ▲ Absicherungsinstrumente: Forward-Rate-Agreements, Swaps, Optionen
- ▲ Risikoberichtswesen
- ▲ Fallbeispiele

Teilnehmerkreis

Verantwortliche aus dem Finanz- und Treasury-Bereich sowie aus Controlling, Risiko-Management und Revision, Kundenbetreuer aus Banken sowie Mitarbeiter des Geld- und Devisenhandels.

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

1. Grundlagen und Risikopolitik

- ▲ Was schreiben wesentliche gesetzliche Vorschriften und international anerkannte Richtlinien für das Risiko-Management in Unternehmen vor?
- ▲ An welchen Vorgaben und „Benchmarks“ sollte sich ein Treasury messen lassen, an welchen nicht?
- ▲ Was ist die „Check-Liste“ für ein professionelles Risiko-Management?

2. Analyse des Währungsrisikos

- ▲ Wann entsteht ein Währungsrisiko und warum ist es häufig schwer zu ermitteln?
- ▲ Wo finden sich direkte und indirekte Währungsrisiken im operativen Geschäft und wie zeigen sie sich im Rechnungswesen?
- ▲ Warum stellen Rechnungswesen und Treasury die Risiken und Sicherungsgeschäfte unterschiedlich dar?
- ▲ Wie erfolgt die systematische Festlegung einer Risikostrategie?

3. Analyse des Zinsänderungsrisikos

- ▲ Welche Erscheinungsformen des Zinsrisikos gibt es?
- ▲ Welche Positionen beinhalten Zinsrisiken?
- ▲ Worin unterscheiden sich Zinssaldo- und Wertisiko?
- ▲ Wie werden die Risiken quantifiziert?
- ▲ Was sind die Stärken und Schwächen der einzelnen Quantifizierungsmethoden?

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

- ▲ **Professioneller Umgang mit Finanzrisiken**
Von der Exposure-Identifizierung bis zum Reporting
- ▲ **Derivative Instrumente**
Währungs- und Zinsinstrumente rechnen und einsetzen

Weitere Seminare und Lehrgänge finden Sie auf unserer Website 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 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

☎ +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