



SCHWABE, LEY & GREINER

# WÄHRUNGS- UND ZINSRISIKO- MANAGEMENT

---

**NEU: Seminare im  
„Hybrid-Format“**

Besuchen Sie unsere  
Seminare vor Ort oder  
sein Sie online  
„live dabei“!

Risikopotenziale erkennen, limitieren und steuern



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

# WÄHRUNGS- UND ZINSRISIKO-MANAGEMENT

Risikopotenziale erkennen, limitieren und steuern



03.-05.11.2020 | Wien und ONLINE  
07.-09.06.2021 | Mannheim und ONLINE  
15.-17.11.2021 | Wien und ONLINE



Tag 1 | Währungsrisiko | 10:00 bis 18:00 Uhr  
Tag 2 | Währungsrisiko | 09:00 bis 12:30 Uhr  
Tag 2 | Zinsrisiko | 13:30 bis 17:00 Uhr  
Tag 3 | Zinsrisiko | 09:00 bis 17:00 Uhr



Level | Grundlagen



Währungsrisiko und Zinsrisiko  
EUR 2.400,- zzgl. USt.

Währungsrisiko oder Zinsrisiko  
EUR 1.700,- zzgl. USt.



**Thomas Schörner**

Partner | Schwabe, Ley & Greiner



**Günther Bauer**

Partner | Schwabe, Ley & Greiner



**NEU: Seminare im  
„Hybrid-Format“**

Besuchen Sie unsere  
Seminare vor Ort oder  
seien Sie online  
„live dabei“!

## Inhalt

Währungs- und Zinsschwankungen können für Unternehmen 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. Auf Basis dieser Informationen ist es möglich, fundierte Entscheidungen zur Risikostrategie zu fällen und in weiterer Folge diese zu implementieren.

Die potenzielle Auswirkung dieser Risiken verlangt eine sorgfältige Wahl der Strategie – auch im Hinblick auf eine nachhaltige Unternehmenssteuerung.

## Themenschwerpunkte

### Grundlagen und Risikopolitik

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

### Analyse des Währungsrisikos

- ▲ Wann entsteht 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?
- ▲ Welche Methoden zur Risikoanalyse und -quantifizierung gibt es?
- ▲ Welche Sicherungsinstrumente gibt es und warum stellen Rechnungswesen und Treasury die Risiken und Sicherungsgeschäfte unterschiedlich dar?
- ▲ Wie erfolgt die systematische Festlegung einer Risikostrategie?

### Analyse des Zinsrisikos

- ▲ Welche Erscheinungsformen des Zinsrisikos gibt es?
- ▲ Welche Positionen in Bilanz und GuV beinhalten Zinsrisiken?
- ▲ Worin unterscheiden sich Zinssaldo- und Wertrisiko?
- ▲ Wie werden die Risiken quantifiziert?
- ▲ Was sind die Stärken und Schwächen der einzelnen Quantifizierungsmethoden?
- ▲ Welche unterschiedlichen Ansätze für eine Risikostrategie gibt es hinsichtlich Kosten- und Risikoaspekten?
- ▲ Welche Sicherungsinstrumente gibt es und worin unterscheiden sie sich?

## Das sagen unsere Teilnehmer

„ Das Thema wurde anhand eines Gesamtbeispiels sehr praxisnah erklärt.

„ Dieses Seminar ist perfekt, wenn man das Grundverständnis des Risiko-Managements erlangen möchte.



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.



## Sie haben Fragen? Wir stehen Ihnen gerne zur Verfügung!



Schwabe, Ley & Greiner GmbH  
Gertrude-Fröhlich-Sandner-  
Straße 3, 1100 Wien  
Österreich

info@slg.co.at  
+43-1-5854830

## Teilnehmerkreis

Mitarbeiter und Führungskräfte, die im Fremdwährungs- oder Zinsrisiko-Management tätig sind oder dieses verantworten sowie Firmenkundenbetreuer aus Banken, die das Tagesgeschäft ihrer Kunden aus deren Perspektive kennenlernen wollen

## Ziele

Auf Basis der theoretischen Grundlagen zur Risikoidentifikation, -quantifizierung und -absicherung wird die praktische Umsetzung anhand zahlreicher Beispiele erläutert. Abschließend werden verschiedene Ansätze in der Risikostrategie und im Berichtswesen beleuchtet und verglichen.

## Praxisbezug

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 93 % der Seminarteilnehmer die von ihnen besuchte Veranstaltung weiter!

## Organisation

Aufgrund der aktuell geltenden Reise- und Teilnahmebeschränkungen bieten wir dieses Seminar in einem Hybridformat an: Es wird vor Ort durchgeführt (unter Beachtung der behördlich begrenzten Teilnehmeranzahl und der entsprechenden Schutzmaßnahmen) und gleichzeitig „live“ online übertragen. Durch die Nutzung einer professionellen Videokonferenzsrausrüstung können virtuelle Teilnehmer ähnlich wie bei einem Besuch vor Ort teilnehmen – d. h. sich an Diskussionen beteiligen, Fragen stellen und auch den Referenten miterleben.

## Teilnahmegebühr

Die Teilnahmegebühr versteht sich pro Person und gebuchter Veranstaltung zzgl. gesetzlicher MwSt. Sie umfasst die Veranstaltungsunterlagen sowie die Verpflegung während der Veranstaltung (Mittagessen sowie Pausenverpflegung) bzw. die Nutzung des virtuellen Konferenzraums.

## Frühbucherrabatt

Bei einer Anmeldung mindestens 60 Tage vor Seminarbeginn gewähren wir einen Frühbucherrabatt von 10 % auf den Nettopreis. Ein Frühbucherrabatt gilt nur bei Zahlung der Rechnung laut Zahlungsbedingungen.

## AGB

Bitte beachten Sie unsere Allgemeinen Geschäftsbedingungen für Ausbildungsveranstaltungen: [www.slg.co.at/ausbildung/agb](http://www.slg.co.at/ausbildung/agb)