



Studieninhalte des Kurses Finanz- und Risikosteuerung

Selbststudiumsteile (s-win – basiert) mit tutorieller Betreuung nach dem ersten und zweiten Präsenzteil

Dauer: je 2 Wochen

Zielsetzung:

Vertiefung anhand von Übungsaufgaben zu den Themen:

- Finanzmathematik
- Grundlagen der Statistik
- Kalkulation
- Marktpreisrisiko

Präsenzteile in der Sparkassenakademie Bayern, Landshut

Gesamt Tage **27**

Finanzmathematische Grundlagen

Dynamische Verfahren der Investitionsrechnung

Standardusancen am Geld- und Kapitalmarkt

Effektivverzinsung

Grundmodell der Marktzinsmethode

Optionspreismodell

Ausgewählte Zinsderivate

Anzahl Tage gesamt **4**

Statistik

Varianz, Standardabweichung, Kovarianz, Korrelation

Normalverteilung

Value at Risk

Anzahl Tage gesamt **2**

Wertorientierte Vertriebssteuerung und Anreizsysteme

Vertriebsstrategie und Planung

Grundzüge einer wertorientierten Vertriebssteuerung

Aufbau erfolgsorientierter Anreizsysteme

Anzahl Tage gesamt

2

Barwertkonzept

Barwertkonzept bei flacher und realer Zinsstrukturkurve

Grundmodell und Barwertmodell im Vergleich

Barwertkonzept, Gesamtbanksteuerung und Vertriebssteuerung

Steuerung mit Barwerten oder laufenden Margen

Behandlung außerplanmäßiger Ereignisse

Kalkulation im variablen Geschäft

Anzahl Tage gesamt

3

Kostenrechnung

Kostenmanagement

Kalkulation von Betriebskosten

Prozessorientierte Plankostenrechnung

Anzahl Tage gesamt

1

Portfolio Selection und CAPM

Das moderne Kapitalmarktmodell

Portfolio Selection

Kapitalmarktklinie

CAPM

Anzahl Tage gesamt

2

Verfahren zum Controlling von Marktpreisrisiken

Klassische Verfahren der Risikomessung

Barwertige Methoden

Umfassende Fallstudie

Anzahl Tage gesamt

5

Adressausfallrisiko

Aufsichtsrechtliche Rahmenbedingungen

Rating

Pricing und Kalkulation

Messung und Steuerung des Adressenausfallrisikos

Anzahl Tage gesamt

5

Asset Allocation

Grundlagen/Investmentprozess

Performance- und Risikomessung

RORAC als wertorientierte Steuerungsgröße

Anzahl Tage gesamt

1

MaRisk und Risikotragfähigkeitskonzept

Risikotragfähigkeit im Rahmen des Aufsichtsrechts

Risikotragfähigkeitskonzeption des DSGV

Weitere Themen zur MaRisk

Anzahl Tage gesamt

2

Prüfung

Schriftliche Prüfung (180 Minuten)

Mündliche Prüfung

Anzahl Tage gesamt

2