

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



Eigenkapitaloptimierte Asset Allokation zwischen Rendite, Risiko & ESG

Rendite-Risiko-Relation durch Vermögensallokation verbessern •
Regulatorische 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 \(FCH\) , 231117, 13.11.2023 - 15.11.2023](#)

14:00 - 17:00 Uhr

Swen Kaiser

Bereich Treasury
Volksbank Mittelhessen eG

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

- Auswirkung der langjährigen EZB-**Niedrigzinspolitik**, verschärften **Kapitalanforderungen** und **steigenden Zinsen** auf die aktuelle **Ertragslage** von (LSI-)Instituten: u.a. Erweiterung des **Investmentspektrums** (z.B. um „grüne Kapitalanlagen“, 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 als stabiler 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** • Begründungen für **aktives Abweichen** von Benchmark • worauf ist bei **Performance-Analyse** zu achten? • Überprüfung der Anlagepolitik iRd Portfoliooptimierung

(dazwischen 15 min. Pause)

Mit freundlicher Unterstützung unseres namhaften und etablierten Kooperationspartners:



Eigenkapitaloptimierte Asset Allokation zwischen Rendite, Risiko & ESG

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Eigenkapitaloptimierte Asset Allokation zwischen Rendite, Risiko & ESG
14.11.2023 (231119) 379,00 €*

(Alternative) Eigenanlagen im Fokus der Aufsicht & Gesamtbanksteuerung
13.11.2023 (231118) 379,00 €*

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	322,15 €
Treue PLUS 20	303,20 €
Treue PLUS 25	284,25 €

Sie interessieren sich für unser TreuePlus-Rabattmodell?
Infos unter <https://fch-gruppe.de/TreueAngebot>

Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen.
Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

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 bankaufsichtliche 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 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.

14.11.2023 14:00 bis 17:00 Uhr

Online-Veranstaltung mit Zoom. Zoom ist der erste Anbieter von Videokonferenzlösungen, dessen Software im Jahr 2021 vom BSI nach dem internationalen Standard Common Criteria zertifiziert wurde.

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.

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.

* 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