



Bisherige Kurs-Teilnehmer schätzten die ALM Academy insbesondere aus folgenden Gründen:

- *Modularer Aufbau erlaubt themenspezifische Weiterbildung in Kleingruppen*
- *Erfahrungsaustausch mit Risiko-Managern anderer Banken*
- *Angenehme Kursatmosphäre mit kompetenter Wissensvermittlung*



ALM Academy 2006 – Details I

ALM Basics (1 Tag)

- Erlernung der Grundlagen und Methoden des statischen ALM: Barwertkonzept, Macaulay Duration, Modified Duration, Key Rate Duration, Value at Risk, Gap-Profil, Ertragsanalyse, Einkommenseffekt
- Interpretation von Kennzahlen und Auswertungen (Repricing Balance Sheet, Cash Flow Balance Sheet, Revenue Analysis, Value at Risk etc.)

ALM Advanced (1 Tag)

Ein state-of-the-art ALM umfasst dynamische Simulationen als Ergänzung zur statischen Perspektive:

- Erlernung der Grundlagen und Methoden zur Durchführung von dynamischen Simulationen
- Praktische Umsetzung mit Focus ALM 4: Annahmendefinition / Aufsetzen der Inputparameter
- Analyse der Ertragsauswirkungen von Hedging-Massnahmen:
"Unter welchen Zinsszenarien bringt unser Payer Swap die gewünschten Resultate bzgl. Risiko resp. Ertrag?"
- Durchführung von Simulationen mittels Case Study

Hedge Accounting/ RRV-EBK (1 Tag)

Hedge Accounting unter RRV-EBK:

- Erlernung theoretischer Grundlagen zum Management von Absicherungs-Derivaten
- Ausführungen zum Zweistufenprozess im Hedge Accounting
- Praktische Umsetzung in Focus ALM 4, Case Study
- Tipps und Tricks, Erfahrungsaustausch



ALM Academy 2006 – Details II

Tipps und Tricks mit Focus ALM 4 (0.5 Tage)

- Benutzerschulung mit Focus ALM 4: Erhöhen Sie Ihre Effizienz im täglichen Umgang mit der Software
- Übersichtliche Verwaltung von Analysen: grundlegende Operationen in Focus ALM und auf dem SQL-Server
- Effiziente Fehlerbehandlung: Check Manager / Validierungsreport / Fehlerprotokoll
- Automatisierung aufwendiger manueller Verarbeitungsabläufe → Nutzung von Batchprozessen in Focus ALM

SNB-Reporting (0.5 Tage)

- Effiziente Prozessgestaltung zur quartalsweisen Erstellung des SNB-Reportings
- Definition des Basis-Setups, Fehlerbehebung in der Zinsrisikomeldung
- Datenabgleich „SNB-Reporting vs. Focus ALM“:
Wie lassen sich die Zahlen der Zinsrisikomeldung mit den Resultaten der Software abgleichen?

Replikation von Bodensatzprodukten (0.5 Tage)

- Ein Klassiker im ALM: Wie sind Produkte ohne feste Zins- und Kapitalbindung zu behandeln?
- Überblick mit kritischer Beurteilung unterschiedlicher Ansätze
 - Erlernung der Grundlagen und Methoden eines „rollierenden Replikationsportfolios“
 - Analyse replikationsbedingter Auswirkungen auf Schlüsselgrößen und auf Absicherungsmaßnahmen

Strategie-Workshop (0.5 Tage)

- Workshop zur Beurteilung unterschiedlicher ALM-Strategien und Hedging-Massnahmen
- Case Study zur Strategie-Analyse: Dynamische Simulation unter Verwendung von Zinsszenarien, Struktureffekten, Konditionenpolitik etc.
 - Strategie-Vergleich unter Berücksichtigung von Risiko- und Ertragsaspekten
 - Erfahrungsaustausch unter den Kursteilnehmern



ALM Academy 2006 - Anmeldeformular

Anmeldung für folgende Academy-Module:

<input type="checkbox"/> ALM Basics	1	Tag	Montag,	11.12.06,	09.00-17.00	CHF 1'590.--
<input type="checkbox"/> ALM Advanced	1	Tag	Dienstag,	12.12.06,	09.00-17.00	CHF 1'590.--
<input type="checkbox"/> Hedge Accounting	1	Tag	Mittwoch,	13.12.06,	09.00-17.00	CHF 1'590.--
<input type="checkbox"/> Tipps und Tricks mit Focus ALM 4	0.5	Tage	Donnerstag,	14.12.06,	09.00-12.00	CHF 890.--
<input type="checkbox"/> SNB-Reporting	0.5	Tage	Donnerstag,	14.12.06,	14.00-17.00	CHF 890.--
<input type="checkbox"/> Replikation von Bodensatzprodukten	0.5	Tage	Freitag,	15.12.06,	09.00-12.00	CHF 890.--
<input type="checkbox"/> Strategie-Workshop	0.5	Tage	Freitag,	15.12.06,	14.00-17.00	CHF 890.--

Kursort: Winterthur (in den neuen Büroräumlichkeiten von AlmafinJaeger)
Wir befinden uns im Swisscom-Tower, nahe beim Hauptbahnhof und sind einfach mit dem Zug zu erreichen.

Anmeldefrist: 27. November 2006

Anmeldungen bitte an: AlmafinJaeger, Theaterstrasse 17, 8400 Winterthur
Fax 052 560 60 99 / Telefon 052 560 60 00
oder Mail: academy@almafinjaeger.com

Aufgrund von Kleingruppen:
Limitierte Teilnehmerzahl

Name, Vorname, Funktion: _____

Name, Vorname, Funktion (2. Teilnehmer): _____

Firma: _____

Adresse: _____

PLZ, Ort: _____

Telefon: _____

Unterschrift: _____