



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

- *Modularer Aufbau erlaubt themenspezifische Weiterbildung in Kleingruppen*
- *Erfahrungsaustausch mit Risiko-Managern anderer Banken*
- *Vermittlung von Best-Practice Wissen aus der Hand von Fachleuten*
- *Angenehme Kursatmosphäre mit kompetenter Wissensvermittlung*

SUNGARD Programm

	Montag, 08. 09. 2008	Dienstag, 09. 09. 2008	Mittwoch, 10.09.2008	Donnerstag, 11.09.2008	Freitag, 12.09.2008
	ALM Basics	Dynamische Simulation Basics	Tips & Tricks mit Focus ALM (Teil 1)	Liquiditätsrisiko-management	ALM Strategie Workshop
Vormittag	Grundlagen & Methoden eines modernen ALM <i>Werte</i> effekt: Mod. & Macaulay Duration, Key Rate Duration, Value at Risk, Eigenkapital-Sensitivität <i>Einkommenseffekt</i> : Zinsbindungsbilanz, Gap-Profil, Ertragsanalyse	Dynamische Simulationen für Einsteiger Erlernung der Grundlagen & Methoden der dynamischen Ertragssimulation Praktische Umsetzung mittels unterschiedlicher Fallstudien in Focus ALM	Benutzerschulung <i>Batchprozesse</i> Automatisierung Manueller Verarbeitung Abläufe z.B. zur Archivierung von Analysen <i>Planungsannahmen</i> Automatisierter Excel-Import von Planungsannahmen zur Verbesserung dynamischer Ertragssimulationen	Modellierung von Liquiditätsrisiken anhand einer Szenario-Analyse Simulation des Überlebenshorizonts anhand einer Fallstudie in Focus ALM. Entwicklung und Backtesting von Massnahmen aufgrund der Simulation.	Analyse und Entwicklung von Handlungsalternativen anhand einer praxisnahen ALCO-Fallstudie <ul style="list-style-type: none"> ▪ Risiko-/Ertragsperspektive ▪ Produkt-/Margenanalyse ▪ Absicherung Konkrete Umsetzung in Focus ALM anhand von Simulationen (in Gruppen)
			Dynamische Simulation Advanced	Tips & Tricks mit Focus ALM (Teil 2)	SNB Reporting
Nachmittag	Interpretation von Kennzahlen & Auswertungen Fallstudie zur Beurteilung und Interpretation der zentralen ALM-Reports und Kenngrößen Bilanzstrukturmanagement Kennenlernen von Instrumenten zur Bilanzsteuerung	Dynamische Simulationen für Fortgeschrittene Berücksichtigung des Kundenverhaltens anhand von Umschichtungsmodellen <ul style="list-style-type: none"> ▪ Analyse Kundenverhalten ▪ Kalibration von Modellen ▪ Plausibilisierung Simulation Nettozinsertrag mit Aufteilung in Konditionen- und Strukturbeiträge Praktische Umsetzung mittels Fallstudie in Focus ALM	Benutzerschulung <i>Reporting mit Focus ALM</i> Excel-Reporting mit Add-in Funktionen <i>Multidimensionales Reporting</i> Reporting über mehrere Dimensionen hinweg: multidimensionale Cubes.	Sicherstellung regulatorischer Anforderungen Definition Basis-Setup, Fehlerbehebung in der Zinsrisikomeldung Datenabgleich „SNB Reporting vs. Focus ALM“: Wie lassen sich die Zahlen der Zinsrisikomeldung mit den Resultaten der Software abgleichen?	Präsentation und Diskussion der Massnahmen. Fristentransformationsstrategien: <ul style="list-style-type: none"> ▪ Übersicht ▪ Analyse und Backtesting ▪ Praktische Umsetzung ▪ Einführung von Strategien

Anmeldung für folgende Academy-Module:

<input type="checkbox"/> ALM Basics	1	Tag	Montag, 08.09.2008,	08.30-17.00	CHF 1'695.--
<input type="checkbox"/> Dynamische Simulation (Basics)	0.5	Tage	Dienstag, 09.09.2008,	08.30-12.00	CHF 850.--
<input type="checkbox"/> Dynamische Simulation (Advanced)	0.5	Tage	Dienstag, 09.09.2008,	13.30-17.00	CHF 850.--
<input type="checkbox"/> Tipps & Tricks (Teil 1)	0.5	Tage	Mittwoch, 10.09.2008,	08.30-12.00	CHF 850.--
<input type="checkbox"/> Tipps & Tricks (Teil 2)	0.5	Tage	Mittwoch, 10.09.2008,	13.30-17.00	CHF 850.--
<input type="checkbox"/> Liquiditätsrisikomanagement	0.5	Tage	Donnerstag, 11.09.2008,	08.30-12.00	CHF 850.--
<input type="checkbox"/> SNB-Reporting	0.5	Tage	Donnerstag, 11.09.2008,	13.30-17.00	CHF 850.--
<input type="checkbox"/> ALM Strategie Workshop	1	Tag	Freitag, 12.09.2008,	08.30-17.00	CHF 1995.--

Paketpreis für alle Module: CHF 6'950.--

Kursort: Winterthur (nahe beim Hauptbahnhof und einfach mit dem Zug zu erreichen)

Anmeldefrist: 15. August 2008

Anmeldungen bitte an: SunGard BancWare, Theaterstrasse 17, 8400 Winterthur
 Fax 052 560 60 99 / Telefon 052 560 60 00
 oder Mail: david.renz@sungard.com

Name, Vorname, Funktion:.....

Mailadresse:.....

Name, Vorname, Funktion (weitere Teilnehmer):

Mailadresse:.....

Firma, Adresse:.....

Telefon:..... Unterschrift:.....

*Aufgrund von Kleingruppen:
 Limitierte Teilnehmerzahl*