

Mendo Web – Onlinekurs (Weiterbildung)

4219 – BVG Basics – Asset Liability Management

Grobbeschreibung

Dieser Onlinekurs gibt den Kursteilnehmenden eine Einführung in das Thema «Asset Liability Management» von Vorsorgeeinrichtungen. Einleitend werden wichtige Begriffe, der Ablauf einer Analyse und die anwendbaren Rechtsgrundlagen erläutert. Danach werden die in der Vorsorgepraxis angewendeten Methoden erläutert sowie die Qualität der Startbilanz einer Analyse und der Annahmen über die künftige Entwicklung der einzelnen Bilanzpositionen diskutiert. Im Weiteren wird die Bedeutung der finanziellen und strukturellen Risikofähigkeit besprochen. Die einfachste Asset Liability Analyse ist der Vergleich zwischen der erwarteten Anlagerendite mit der Soll- bzw. der Zielrendite der Vorsorgeeinrichtung. Abschliessend werden die deterministischen und stochastischen Asset Liability Analysen aufgezeigt und deren Resultate aus Sicht der Vorsorgeeinrichtung erörtert.

Anzahl Lektionen: 2

Lernziele

Die Teilnehmenden...

- Kennen die wichtigen Asset Liability Methoden
- Verstehen die Bedeutung der Startbilanz und der Annahmen über die künftige Entwicklung der einzelnen Bilanzpositionen
- Kennen den Unterschied der strukturellen und finanziellen Risikofähigkeit
- Sind vertraut mit dem Vergleich der erwarteten Anlagerendite mit der Soll- bzw. der Zielrendite
- Können die Resultate von deterministischen und stochastischen Asset Liability interpretieren

Akkreditierung(en):



Anzahl Credits: 2

Normlaufzeit

Nach dem Start der Lektion bleiben die Zugangsdaten während 3 Monaten gültig. Danach verfällt der Zugang automatisch.

Allgemeine Geschäftsbedingungen

Wir verweisen auf unsere allgemeinen Geschäftsbedingungen. Diese befinden sich auf mendoweb.

Methodikbeschreibung

Nr.	Methode	Thema / Inhalt	Mittel	Dauer in Min.
1		Lernvideo studieren „Asset Liability Management für Vorsorgeeinrichtungen“	1 Lernvideo	5
2		Leseauftrag Skript „Rechtsgrundlagen für Asset & Liability Analysen“ Aktives Lesen des Grundlagentexts, persönliche Notizen erfassen, individuelle Zusammenfassung	E-Skript <i>3 Seiten</i>	18
3		Lernvideo studieren „Methoden für Asset Liability Analysen“	1 Lernvideo	5
4		Lernvideo studieren „Datenbasis einer Asset Liability Analyse“	1 Lernvideo	5
6		Leseauftrag Skript „Historische Daten für Asset Liability Analysen gemäss Pictet Studie“ Aktives Lesen des Grundlagentexts, persönliche Notizen erfassen, individuelle Zusammenfassung	E-Skript <i>5 Seiten</i>	30
5		Lernvideo studieren „Finanzielle und strukturelle Risikofähigkeit“	1 Lernvideo	5
7		Lernvideo studieren „Erwartete Anlagerendite und Soll- bzw. Zielrendite“	1 Lernvideo	5
8		Lernvideo studieren „Deterministische und stochastische Asset Liability Analysen“	1 Lernvideo	5
9		Abschlusstest Onlinekurs Test bestanden und Kurs abgeschlossen: min. 80% richtige Antworten.	E-Test <i>12 Fragen</i>	15

Icons Methodik:

Leseauftrag		Lernvideo		Test	
-------------	---	-----------	---	------	---