

## Webinar

### I28 – Zinsrisiko Simulation

TMA Austria

Freitag, 01.02.2019

13:30 bis 14:15 Uhr

Dauer ca. 45 Min

Kostenlose Anmeldung: [i28@financetrainer.com](mailto:i28@financetrainer.com)

Internetverbindung ist Voraussetzung - Sie erhalten zum Webinar Start einen Link

#### Ziel:

Ergebniszuwachs durch Zinsrisikomanagement, auch bei wechselnden Zinserwartungen.  
Reaktionssicherheit durch Übung mit „Paper Trades“ ([i28.financetrainer.com](http://i28.financetrainer.com) Zinsrisikosimulation)

#### Ausgangssituation:

Nach dem historischen Zinstief erwartet die Bank, dass die Zinsen in nächster Zukunft ansteigen, so dass die aktuelle Zinspositionierung zu hinterfragen ist. Die Zinsrisikoposition der i28 Bank sollte auf den erwarteten Zinsanstieg ausgerichtet werden. Der Vorstand erwartet sich durch Ihre Maßnahmen ein um 15 Mio. EUR verbessertes Ergebnis gegenüber „laufen lassen“. Eine Belastung der Zinsspanne (negativer Strukturbeitrag) wird nicht akzeptiert.

#### Inhalte:

Stufenweiser Einstieg in die Zinsrisikosteuerung mit Fokus „Total Return“. Das Ziel ist die Verbesserung des Zinsrisikoergebnisses unter Einhaltung der Limits.

1. Nutzung des interaktiven Tutorials – Advanced Level
2. Vertiefung des Verständnisses über das Konzept „Total Return“ unterstützt durch die ALM Professional Cyber\*School – Modul Zinsrisiko
3. Erste Ausrichtung der Strategie auf die Zinsprognose und Strukturbeitrags-Vorgabe

#### Vertiefung:

Im Anschluss an das Webinar bleibt die i28 Simulation (<http://i28.financetrainer.com>), mit der Sie Maßnahmen simulieren können, bei Ihnen. Das Programm ist für Ihre persönliche Nutzung kostenfrei. Sie können damit so viel Sicherheit in der Zinsrisikosteuerung holen, wie Sie wollen.