



Votierung, Limitsysteme & Co. - Sichere Kreditentscheidung in Ihrem Depot A

Buchungsnummer
ST0622-024

Diese Veranstaltung richtet sich an:

VorständInnen, Führungskräfte und SpezialistInnen aus der Marktfolge Aktiv, Treasury und der internen Revision

Lernen Sie wichtige
Anforderungen"nen sicheren
Kreditentscheidungsprozess
kennen.

Verschaffen Sie sich einen
umfassenden Überblick
darüber, worauf Sie bei der

Analyse und dem Vortierung
von z. B. Spezialfonds achten
müssen und erfahren Sie,
welche Kennzahlen für sichere
Kreditentscheidungen hilfreich
sind und wie Sie diese
interpretieren können.

Veranstaltungsart

Seminar

Dauer (in Tagen)

2

Termin

07.02.2022 - 08.02.2022

Zu erreichender Abschluss

Teilnahmebescheinigung

Preis

1.365,00 €

Aktions- und Gutscheincodes werden"iteren Bestellprozess berücksichtigt.

Beschreibung

Eigenständige Kreditanalyse zur verlässlichen Beurteilung Ihrer Emittenten- und Kontrahentenlimite

In unserem Seminar erhalten Sie mit dem „Kredit-Check Depot A“ Leitlinien für eine aufsichtsrechtlich vertretbare Kreditanalyse und Limit-Einräumung bei Eigenanlagen.

Außerdem lernen Sie, mithilfe von Beurteilungsstandards und Musterbeschlüssen zukünftig fundierte und zuverlässige Kreditanalysen und Risikobeurteilungen vorzunehmen.

Bringen Sie Ihr Wissen auch"n neuen Anforderungen rund um TLAC und MREL auf den aktuellen Stand und

erfahren Sie, welche Auswirkungen diese auf Ihr Limitsystem zukünftig haben werden.

Hinweis:

Dieses Seminar ist auch Modul 1 unserer Zertifizierung zum "Risikoanalysten Eigenanlagen ADG". Sind Sie an dieser Zertifizierung interessiert? Dann schauen Sie sich gerne auf der rechten Seite unter Verwandte Veranstaltung, die Ausschreibung "esem Programm" an. Sprechen Sie uns für weitere Informationen direkt an.

Bitte bringen Sie zum Seminar Ihre internen Unterlagen wie z.B. Kreditbeschlüsse mit. Sie sollten auch über Ihre interne Depot-A-Struktur informiert sein.

Inhalte

Rating – Analyse im Depot A-Management – Anforderungen eines sicheren Kreditentscheidungsprozesses

- Rechtsprechung und Beurteilungskriterien zu Risikogeschäften – Haftung von VorständIn, Aufsichtsrat, Leiter Risikocontrolling, interne Revision
- Verwendung externer Bonitätseinschätzungen – Wie kann eine eigenständige Überprüfung und Dokumentation wirksam erfolgen?
- Prozessablauf und Schnittstellen zwischen Kredit-Marktfolge und Treasury
- MREL und TLAC: neue Weichenstellung für das Limitsystem
- Berücksichtigung von Liquiditätskosten bei Depot A – Investitionen – Umsetzen des Liquiditätstransferpreissystems

Analyse und Votierung von Spezialfonds

- Aktuelle Anforderung bei fremd- und eigengesteuerten Fonds
- Risikobetrachtungshorizont im Fokus der Bankenaufsicht
- Bonitätskriterien für eine sichere Votierung
- Anlagen in Spezialfonds: Besonderheiten bei der Bonitätseinschätzung
- Immobilien als Beimischung im Depot A: Welche Standorte bevorzugen institutionelle Investoren?

Rating-Analyse und Kreditentscheidung bei Industrie- und Schwellenländern

- Ratingprozess bei Staatsanleihen
- Maßgebliche Bonitäts-Kennziffern für die Analyse und Votierung?
- Kreditwürdigkeit deutscher Bundesländer
- Auf der Suche nach höheren Zinskupons – besondere Anforderungen an die Rating-Analyse bei Anleihen aus Schwellen- und Entwicklungsländern
- Aufbau von Kennzahlen- und Ratingreports für ausgewählte Länder

Unternehmensanleihen, Schuldscheindarlehen, Aktien und CLNs – Welche Kennzahlen sind für eine sichere Kreditentscheidung hilfreich?

- Ratingprozess bei Unternehmensanleihen, Schuldscheindarlehen und Aktien
- Bonitätsanforderungen der führenden Ratingagenturen im Überblick
- Welche Bonitäts-Kennziffern stehen der Marktfolge bei der Votierung zur Verfügung?

Anleihen, Covered Bonds und klassische Pfandbriefe auf dem Prüfstand

- Ratingprozess bei Banken und Versicherungen
- Bewertungskennzahlen bei unbesicherten Anleihen, Covered Bonds und Pfandbriefen
- Beurteilung des Deckungsstocks bei Pfandbriefen

Nutzen

- Über eine zielgerichtete Kreditanalyse vermeiden Sie Risiken im Depot A.
- Sie lernen Beurteilungsstandards"nem typischen Muster-Depot im Bereich Eigenanlagen kennen.
- Sie erhalten die Möglichkeit"nem Bankübergreifenden Erfahrungsaustausch.
- Sie können die gewonnene Erkenntnisse im Rahmen des "Zertifizierte/r Risikoanalyst Eigenanlagen ADG" vertiefen und Ihre Kompetenzen ausbauen.

Dozenten

Achim Schulz, Schulz & Partner GmbH