



## Basiswissen Treasury-Management

Buchungsnummer

**ST23-00270**

Diese Veranstaltung richtet sich an:

**Führungskräfte und SpezialistInnen, die für den Bereich des Eigenanlagenmanagements neu verantwortlich sind, die eine stellvertretende Position in diesem Bereich übernehmen sollen oder ihr Wissen auffrischen möchten.**

Im Treasury-Management sind Sie dafür verantwortlich, dass stets genug Liquidität für das operative Geschäft vorhanden ist. Besonders Themen wie Zahlungsverkehr und Cash Management werden daher großgeschrieben. Lernen Sie die finanzmathematischen und betriebswirtschaftlichen Grundlagen, die dem Treasury-Management zu Grund liegen kennen sowie der Einsatz von ausgewählten Anlagestrategien. Vertiefen Sie diese Erkenntnisse mit den notwendigen aufsichtsrechtlichen Anforderungen und zahlreichen Geld- und Kapitalmarktprodukten.

Veranstaltungsart

**Seminar**

Dauer (in Tagen)

**2**

Termin

**13.11.2023 - 14.11.2023**

## Preis für Mitglieder des Fördervereins

KundInnen, die Mitglied im [Förderverein](#) sind, erhalten den Mitgliederpreis.

**1.332,00 €**

Mitgliederpreis [Info](#)

Preis

**1.480,00 €**

Bitte beachten Sie – Ihr individueller Preis wird Ihnen erst nach erfolgreichem Login angezeigt

## **Beschreibung**

Produkte und Anlagestrategien im Griff behalten

Das Treasury-Management umfasst die Steuerung der Gesamtbankrisikopositionen, wie beispielsweise Marktpreis-, Liquiditäts- und Adressrisiken aus Kunden- und Eigengeschäften. Ein wesentlicher Bestandteil ist das Eigenanlagenmanagement und die damit verbundene Steuerung des Depot-A. Gerade vor dem Hintergrund des zunehmenden Ertragsdrucks und der ständig wachsenden aufsichtsrechtlichen Anforderungen ist es wichtig, das Treasury-Management auf solide Füße zu stellen.

In unserem Fachseminar vermitteln wir Ihnen praxisnah das hierfür notwendige Handwerkszeug.

Hinweis:

Dieses Grundlagenseminar dient der Vorbereitung auf das Qualifizierungsprogramm zum „Zertifizierten Treasury-Manager“. Gerade Neueinsteigern, welche das Qualifizierungsprogramm absolvieren möchten, empfehlen wir den Besuch dieses Seminars.

## **Inhalte**

- Definition Treasury-Management
- Finanzmathematische Grundlagen
  - Rendite, Barwert, Performance, Duration, VaR
- Aufsichtsrechtliche Anforderungen
  - Kapitalanforderungen inkl. SREP
  - LCR & NSFR
  - Verbundliquidität
- Betriebswirtschaftliche Grundlagen
  - Barwertige und normative Risikotragfähigkeitskonzeption
  - Strategische Vermögensallokation
- Geld- und Kapitalmarktprodukte
  - Anleihen
  - Ausgewählte Fonds (z. B. Rentenfonds, Aktienfonds, Immobilienfonds)
  - Ausgewählte Zinsderivate (z. B. Zinsswap, Swaption)
  - Kreditderivate
  - Strukturierte Produkte (z. B. kündbare Anleihen, MinMax-Floater)

## **Nutzen**

- Sie erhalten grundlegende Kenntnisse zu den für das Treasury-Management relevanten

aufsichtsrechtlichen und betriebswirtschaftlichen Anforderungen, inklusive Portfoliotheorie.

- Sie kennen die wesentlichen Geld- und Kapitalmarktprodukte, die im Treasury-Management eingesetzt werden.
- Sie lernen Anlagestrategien zum Einsatz der vorgestellten Produkte kennen und wissen, wie Sie Risiken gezielt steuern und Zusatzerträge erzielen können.
- Dieses Grundlagenseminar bereitet Sie zusätzlich für das Qualifizierungsprogramm zum "Zertifizierten Treasurymanager" vor.

## **Dozenten**

Kay Böckmann, DZ BANK AG

Henrik Bernds, DZ BANK AG