

**Seminar**

# Basiswissen Treasury-Management

**Dozenten:**

Kay Böckmann

(DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank)

Henrik Bernds

(DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank)

**Termin:**

08.11. – 09.11.2021

Cooperative. Leadership. Development.

**Diese Veranstaltung richtet sich an:**

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

**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.

**Ihr 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.

**Inhaltsschwerpunkte:**

- 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)

## Organisatorisches

### Ihre Dozenten:

Kay Böckmann, DZ BANK AG  
Henrik Bernds, DZ BANK AG

Fax-Anmeldung 02602 14 95-500

### Termin:

08.11. - 09.11.2021

### Anmelde-Nr.:

ST0621-390

### Preis:

EUR 1.060,- für Mitglieder der ADG/des Fördervereins  
EUR 1.325,- für Nicht-Mitglieder

Diese Veranstaltung kann auch in Ihrer Region angeboten oder als  
Qualifizierungsmaßnahme direkt in Ihrem Haus durchgeführt werden

# Basiswissen Treasury-Management

Name, Vorname

Position

E-Mail Teilnehmer

E-Mail Hauptansprechpartner

Institut

Telefon Teilnehmer

Straße/Postfach

Zugangskennung VR-Bildung

PLZ/Ort

Datum      Unterschrift und Stempel

Wir buchen Ihnen automatisch ab dem Vorabend der Veranstaltung ein Zimmer im Hotel inklusive aller zusätzlichen Leistungen. Hotel Schloss Montabaur verfügt über drei Zimmerkategorien\*. Bitte kreuzen Sie Ihre bevorzugte Wahl unbedingt an.

Standard                       Comfort                       Superior

Die aktuellen Zimmerpreise finden Sie online unter: [www.adgonline.de/adg-hotelpreise](http://www.adgonline.de/adg-hotelpreise). Wir setzen alles daran, Ihnen nach Verfügbarkeit Ihre Wunschkategorie zu optionieren.

Wenn Sie nicht am Vorabend anreisen oder gar keine Übernachtung benötigen, kreuzen Sie dies bitte an:

keine Vorabendanreise       keine Übernachtung

Mit welchem Verkehrsmittel werden Sie anreisen?

Bahn                                       PKW                                       PKW-Mitfahrer

Ihre Seminarunterlagen und Skripte stellen wir Ihnen digital zur Verfügung.

\*Bei Übernachtung in externen Hotels gelten diese Zimmerkategorien nicht.

## Ansprechpartner für inhaltliche Fragen

Selbstverständlich stehen wir Ihnen auch gerne für weitergehende Fragen oder Informationen zur Verfügung.

**Christian Malm**

Bachelor of Arts

T: +49 (2602) 14 112

F: +49 (2602) 1495 112

[christian\\_malm@adgonline.de](mailto:christian_malm@adgonline.de)

## Anmeldung/organisatorische Fragen

### Servicecenter Seminare

T: (02602) 14-500

F: (02602) 1495-500

[service@adgonline.de](mailto:service@adgonline.de)

Akademie Deutscher Genossenschaften ADG

Schloss Montabaur | 56410 Montabaur

[www.adgonline.de](http://www.adgonline.de)

Ein Angebot im Rahmen des ADG-Jahresprogramms 2021