

Qualifiziertes Zinsmanagement von Zinspapieren mit Derivaten, Grundlagen Depot-A sowie aufsichtsrechtliche Anforderungen für Wertpapierspezialisten

EDZ-25-dod

Zielgruppe

- ✓ VR-Vermögensplaner
- ✓ VR-Individualkundenbetreuer
- ✓ angehende Wertpapierspezialisten
- ✓ Verantwortliche in der Anlageberatung

Ihr Nutzen

Im zweiten Präsenzmodul lernen Sie die Besonderheiten des Zinsmanagements mit Derivaten kennen und bauen ein grundlegendes Wissen im Eigenhandel / Depot-A-Management auf. Ein wichtiger Baustein, um in Ihren Häusern über das reine Kundengeschäft hinaus professionell unterstützen zu können. Darüber hinaus beschäftigen Sie sich mit den aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen für Wertpapierspezialisten.

Inhalt

- ✓ Bondmanagement
 - ✓ Zinsstrukturkurven und die Bedeutung der impliziten Zinsterminsätze (Forward Rates)
 - ✓ Analyse und Steuerung von Rentenpapieren mit dem Durationskonzept
 - ✓ Swaps im Zinsmanagement
 - ✓ Erklärung und Cash Flow Betrachtung von Financial Swaps
 - ✓ Swap Variationen (Forward, Amortizing, etc..) und Spezifikationen
 - ✓ Funktionen und Anwendung von Asset Swaps und Zins-/ Währungsswaps im Kundengeschäft
- ✓ Zinsoptionen
 - ✓ Funktionen und Cashflow-Betrachtung von Caps, Floors, Collars, Swaptions
 - ✓ Chance-Risiko-Vergleich von Zinsoptionen
 - ✓ Anwendungsmöglichkeiten im Kundengeschäft
 - ✓ Statistik zum Optionspreisverständnis und Optionsbewertung
 - ✓ Lage- und Streuungsparameter / Standardnormalverteilung / Korrelationsrechnung
 - ✓ Analyse von Produkten mit Zinsstrukturen
 - ✓ Ausgewählte strukturierte Anleihen
 - ✓ Caps, Floors, Swaps und Swaptions in strukturierten Anleihen und Alternative Anlageformen
- ✓ Liquiditätssteuerung im Depot A
 - ✓ LCR-Kennzahl
 - ✓ Refinanzierungsmöglichkeiten
 - ✓ Produkte im Depot A
 - ✓ Strategien im Depot A
 - ✓ Steuerung Zinsänderung- und Adressrisiken (Mikro & Makro)
 - ✓ Praktische Anwendungsfälle
- ✓ Aufsichtsrechtliche Besonderheiten für Wertpapierspezialisten
 - ✓ Hausmeinung, Vertriebsvorgaben, Devisentermingeschäfte, Derivative Geschäfte
 - ✓ Sachkunde Fondsadvisory
 - ✓ Aufsichtsrechtliche Grundlagen und Organisatorische Anforderungen

(Themenbereiche: Anlageberatung, Interessenkonfliktmanagement, Mitarbeitergeschäfte, WpHG/MaAnzVO, Marktmissbrauch) > Organisatorische Anforderungen > Sachkunde Finanzportfolioverwaltung > Ausführungsgrundsätze und organisatorische Anforderungen > Aufzeichnungspflichten, Zuwendungen,

Interessenkonfliktmanagement > Product Governance
> Geeignetheitsprüfung/Kundenangaben >
Berichtspflichten > Finanzportfolioverwaltungsvertrag >
Sachkunde der Mitarbeiter > Nachhaltigkeit
> Offenlegungsverordnung

 **Termin**

 **Ort**
Frankfurt

 **Preis**
1.590,00 €

 **Ansprechpartner**

Elke Kerschenlohr

08461/650-1363

elke.kerschenlohr@abg-bayern.de

Nina Zacherl

08461/650-1333

nina.zacherl@abg-bayern.de

Buchen

ABG  