

Folgen der Zinsentwicklung für Bewertungsergebnis Wertpapiere
• Erträge aus alternativen Assets • ESG-Faktoren im Depot A •
Überwachung Spezialfonds!



Zertifizierter Spezialist Depot A (FCH)

Eigenanlagen im Fokus der Aufsicht • Ergebnispotenziale in der Asset Allokation • Spreadrisiken im Depot A • neue Vorgaben für Risikoüberwachung bei Spezialfonds-Anlagen

Dieses Zertifikat besteht aus 4 Modulen und findet im Zeitraum 11. - 14. November 2024 statt

Überblick über die einzelnen Module des Zertifikat-Lehrgangs:

11.11.2024, 10-13 Uhr: (Nachhaltige) Eigenanlagen im Fokus der Aufsicht & Gesamtbanksteuerung (SE2411007)

Einhaltung der neuen MaRisk 2024 für Zins- und Kreditspread-Risiken • Aufstockung von (neuen) Assetklassen • Durchschau auf Risikopositionen in „grünen“ Kapitalanlagen

- Erkenntnisse der Bankenaufsicht über aktuelle Risiken im Depot A aufgrund 44er Prüfungen, Aufsichtsgespräche und Meldewesen-Daten
- Aufbau von Risikopositionen – kritische Analyse der Aufstockung der Assetklassen Immobilien, nachhaltige Kapitalanlagen & Spezialfonds
- MaRisk mit Depot A-Bezug: kreditprozessuale Vorgaben für Risikoüberwachung von Spezialfonds & Bewertung von Kreditspread-Risiken

12.11.2024, 10-13 Uhr: Depot A-Analyse: Heben von Ergebnispotenzialen in der Asset Allokation (SE2411008)

Verbesserung der Rendite-Risiko-Relation mittels Vermögensallokation • Anforderungen und ESG im Allokationsprozess • Einfluss von Sachanlagen und Volatilitätsstrategien

- Vorhalten hochliquider, eigenmittelschonender Anlageklassen (HQLA) • Optimierung von risikogewichteten Aktiva (RWA) • ESG-Faktoren
- Hürden bei der Zusammenstellung der Assetklassen - historische Zeitreihen zur Validierung von Rendite, Risiko und Diversifikationsbeitrag
- Kritische Überprüfung der Vermögensallokation im Portfoliomanagement - Zielerreichung bei strategischer und taktischer Asset Allokation

13.11.2024, 10-13 Uhr: Spreadrisiken im Depot A: Vorgaben • Risikotreiber • Stress-/Szenarien (SE2411009)

Kreditspreadrisiken (CSRBB) als Teil des Kredit- bzw. Marktpreisrisikos oder als eigene Risikoart? • Einfluss von CSRBB auf die Risikotragfähigkeit • Sensitivitäten & Kennzahlen

- Erfassung und Bewertung von Credit Spread-Risiken im Bankbuch (CSRBB) in der Risikoinventur unter Beachtung von Risikokonzentrationen
- Modellierung des CSRBB und Abbildung von Abhängigkeiten zwischen Credit

Thomas Teitge

Abteilungsleiter Eigenanlagen
Volksbank Kassel Göttingen eG

Clemens Dargel

Prüfungen / Bankinterne Risikomodelle
(B Bereich Banken und Finanzaufsicht
Deutsche Bundesbank

Swen Kaiser

Bereich Treasury
Volksbank Mittelhessen eG

Patrick Steinwachs

Bilanzstrukturmanagement/Treasury
Evangelische Bank eG

Annika Eberwein

Risikocontrollerin Controlling
Kasseler Sparkasse

Spreads, Ratingveränderungen & Ausfallwahrscheinlichkeiten

- Überführung erwarteter CSRBB-Verluste in Risikotragfähigkeit-Konzept - Folgen für Risikodeckungsmassen-Berechnung und Risikobelastung

14.11.2024, 10-13 Uhr: Spezialfonds-Anlagen: Neue Vorgaben für Risikoüberwachung/-steuerung (SE2411010)

Früherkennung, Bewertung, Steuerung und Überwachung typischer Risiken bei Eigen- und Spezialfonds-Anlagen sowie deren Verankerung im internen Kontrollsystem (IKS)

- Überführung von Spezialfonds-Risiken in normative und ökonomische Risikotragfähigkeit-Perspektive – (z.T.) Durchschau auf Einzelpositionen
- Integration von Spezialfonds-Anlagen in die Banksteuerung - Ableitung angemessener (Stress-) Szenarien • Sicherstellung der Datenqualität
- Spezialfonds-Reporting - zeitnahe, durchgängige Überwachung von Fondsanlagen in der Asset Allokation

Zertifizierter Spezialist Depot A (FCH)

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Zertifizierter Spezialist Depot A (FCH)

11.11.2024 - 14.11.2024 (SE2411006)

1.796,00 €*

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	1.526,60 €
Treue PLUS 20	1.436,80 €
Treue PLUS 25	1.347,00 €

Wenn Sie eine individuelle Beratung zum Thema benötigen, unterstützen wir Sie gerne, klicken Sie hier: <https://www.fch-gruppe.de/consult>

Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen. Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

Ich kann nicht am Seminar teilnehmen und bestelle deshalb die Seminarunterlagen als PDF zu den oben angekreuzten Seminaren (150,00 € *** je Seminardokumentation)

Anmelden / Bestellen

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an: (Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Die unsichere Zinsentwicklung hat Auswirkungen auf **Kundengeschäft** und **Eigenanlagen** im Depot A der (LSI-) Banken. Neben dem **Bewertungsergebnis** der **Wertpapiere** (in Abhängigkeit der Duration des Portfolios) sind vermehrt **alternative Investments** vor Hintergrund der **Kapitalanforderungen** in der **Asset Allokation** zu beachten. Daneben sollten Institute auf der Suche nach lukrativeren Anlageformen nicht nur **Ertragschancen**, sondern auch die **Risikopositionen** im Blick behalten. Außerdem spielt die Risikoüberwachung/-steuerung von **Spezialfonds-Anlagen** eine wesentliche Rolle. Infolge der vormals langen **Niedrigzinsphase** und **neuer Anlageformen** ist ein Verständnis über Wirkungszusammenhänge im Depot A unerlässlich, um **Fehlsteuerungsimpulse** zu erkennen und zu **vermeiden**. In diesem Lehrgang können Sie Fachwissen und Methodenkompetenz erwerben und auffrischen.

11.11.2024 - 14.11.2024

Tagungsort

ONLINE-Veranstaltung mit ZOOM, der Zugang erfolgt über "meinFCH", Sie erhalten rechtzeitig vor dem Seminar eine E-Mail, Zoom, Tel +49 6221-998980,

Der Zugang zum Seminar erfolgt über Ihren persönlichen Nutzerbereich in „MeinFCH“. Informationen zum Zugang und eine Anleitung erhalten Sie spätestens eine Woche vor dem Seminar. Ihre Teilnahmebestätigung und die Seminardokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei gemeinsamer Anmeldung in derselben Buchung einen Rabatt von **20%**.

Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung Ihre Anmeldebestätigung/Rechnung. Bitte überweisen Sie den Rechnungsbetrag innerhalb von 30 Tagen nach Zugang der Rechnung.

Eine Stornierung Ihrer Anmeldung ist nicht möglich. Eine kostenfreie Vertretung durch Ersatzteilnehmer beim gebuchten Termin dagegen schon. Der Name des Ersatzteilnehmers muss dem Veranstalter jedoch spätestens vor Seminarbeginn mitgeteilt werden. Wir weisen darauf hin, dass „Teilnahmen“ von anderen als den gebuchten Teilnehmern nicht gestattet sind und Schadensersatzansprüche des Veranstalters auslösen. Filmmitschnitt

Bei Absage durch den Veranstalter wird das volle Seminarentgelt erstattet. Darüber hinaus bestehen keine Ansprüche. Änderungen des Programms aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

Durch die Teilnahme am Seminar erhalten Sie 0 CPE-Punkte als Weiterbildungsnachweis für Ihre Zertifizierung.

* zzgl. 19 % MwSt. ** inkl. 7 % MwSt. *** zzgl. 7 % MwSt.

Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die FCH AG und ihre Dienstleister (z. B. Lettershop) verwenden Ihre personenbezogenen Daten für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen ausgewählte Fach- und Produktinformationen per Post zukommen zu lassen. Sie können der Verwendung Ihrer Daten jederzeit durch eine Mitteilung per Post, E-Mail oder Telefon widersprechen.

Senden Sie mir bitte Fach- und Produktinformationen sowie die Banken-Times SPEZIAL für meinen Fachbereich kostenfrei an meine angegebene E-Mail Adresse (Abbestellung jederzeit möglich).

Senden Sie uns Ihre Bestellung per Mail an:
info@fch-gruppe.de

oder schriftlich an:
FCH AG
Im Bosseldorn 30, 69126 Heidelberg
Fax: +49 6221 99898-99

Weitere Informationen erhalten Sie unter:
+49 6221 99898-0
oder unter **www.FCH-Gruppe.de**

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen