

# TREASURYMANAGEMENT

## AUFGABEN DER TREASURY UND INTEGRATION IN DIE GESAMTBANK

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Die Aufgaben der Treasury sind vielfältig und in jedem Institut unterschiedlich. Daher sind die Steuerung des Liquiditätsrisikos, das Management der Zinsänderungs- und Währungsrisiken und nicht zuletzt auch die Behandlung des Kreditrisikos wichtige Elemente.</p> <p>Ziel dieses Seminars ist es, einen Überblick über die relevanten Themenstellungen im Treasuryumfeld zu vermitteln: Diese gehen von den Herausforderungen aus der Regulatorik und der Risikosteuerung über Instrumente bis hin zur Strategie. Praxisorientierte Beispiele sollen eine integrierte Gesamtbetrachtung vermitteln. Hierzu hat 1 PLUS i den IMAAP-Ansatz entwickelt.</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>☰ Einführung <ul style="list-style-type: none"> <li>● Einordnung wichtiger Begriffe</li> <li>● Wirkungszusammenhänge und Abhängigkeiten in der Gesamtbank als Rahmenbedingungen für das Treasury</li> </ul> </li> <li>☰ Regulatorischer Rahmen <ul style="list-style-type: none"> <li>● Überblick über die wichtigsten Normen und Entwicklungen im Liquiditätsrisikoumfeld</li> <li>● Rolle der Kennzahlen LCR und NSFR im Treasurymanagement</li> </ul> </li> <li>☰ Risikoarten im Treasury <ul style="list-style-type: none"> <li>● Treasuryansätze für das Liquiditäts-, Zinsänderungs- und Kreditrisiko</li> <li>● Entstehung des Liquiditätsrisikos und Gegenüberstellung der Risikoarten</li> <li>● Der „SPRS“ Analyseprozess und die Bedeutung der Cashflows aus verschiedenen Produkten</li> </ul> </li> <li>☰ Instrumente in der Steuerung <ul style="list-style-type: none"> <li>● Cashfloworientierte Steuerung</li> <li>● Strukturierte Risikotransferinstrumente (ABS)</li> <li>● Repogeschäfte</li> <li>● Pfandbriefe</li> </ul> </li> <li>☰ Treasury-Setup und Steuerungsstrategien <ul style="list-style-type: none"> <li>● Abgrenzung typischer Steuerungsstrategien für Markt- und Adressrisiken: Spektrum von passiven bis aktiven Strategien</li> <li>● Einbindung des Liquiditätsrisikos: Collateral Management</li> <li>● Performancerechnung</li> <li>● Risikolimitierung für den ICAAP: Risikosteuerung und –begrenzung mittels LVaR</li> <li>● Definition von Bewertungskurven und Abgrenzung des Liquiditätsspreads</li> <li>● Methoden für Performancerechnung und Beispielrechnungen</li> <li>● Vorstellung und Diskussion eines ganzheitlichen Steuerungsansatzes IMAAP</li> </ul> </li> <li>☰ Organisatorische Aspekte im Treasuryprozess</li> </ul>	<p><b>KATEGORIE Risikomanagement</b></p> <p>G A P <b>R</b></p> <hr/> <p><b>SEMINARDAUER</b></p> <p>1 2 <b>3</b> 4 5</p> <hr/> <p><b>SEMINARNUMMER R_08</b></p> <hr/> <p><b>SPEZIALISIERUNGEN</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● Verschiedene Prozessabläufe im Zusammenhang mit der Aufbau- und Ablauforganisation</li> <li>● Funding der anderen Handelsaktivitäten (Interne Geschäfte und End-of-Day-Refinanzierung)</li> <li>● Fremdwährungsrisikosteuerung und Besonderheiten der Positionsführung im FX-Handel</li> </ul>