

21.09.2020 - 11.05.2021

von 09.00 Uhr bis 13.00 Uhr

## Fachseminar Treasury | 250

### Modul 1 - 3 , Abschlusskolloquium

#### **Zielgruppe**

Top-Spezialisten und Führungskräfte der Sparkassen-Finanzgruppe, die bereits Kenntnisse und Erfahrungen im Bereich der Geschäftspolitik, Unternehmensplanung und -steuerung (idealerweise insbesondere in der Gesamtbanksteuerung) oder im Eigenhandel vorweisen können und an der Entwicklung oder dem Aufbau des Treasury in Sparkassen beteiligt sind

#### **Ziele**

Mit dem Besuch des Fachseminars für Treasury werden Sie, aufbauend auf Ihren bisherigen Erfahrungen, in die Lage versetzt, an der Entwicklung und dem Aufbau eines Treasury-Systems mitzuwirken. Sie lernen, wichtige Instrumente für eine ergebnis- und risikoorientierte Steuerung des Treasury (Gesamtbanksteuerung und Eigenhandel) zu nutzen. Darüber hinaus erfahren Sie, wie einschlägige Produkte zu bewerten und bezüglich ihres Risikogehalts einzuschätzen sind.

Die Teilnehmer des Fachseminars können ein Zertifikat („Geprüfte Spezialistin für Treasury Sparkassen-Finanzgruppe“ / „Geprüfter Spezialist für Treasury Sparkassen-Finanzgruppe“) erwerben. Die Voraussetzung ist das erfolgreiche Bestehen einer Hausarbeit und einer mündlichen Prüfung (Kolloquium).

#### **Inhalte**

##### **Modul 1**

- Einführung in das Treasury-Management in Sparkassen
- Finanzmathematik und Statistik
- Derivate (Eurex, OTC)
- Risikomanagementprozess
- Aufsichtsrecht

##### **Modul 2**

- Produktkalkulation
- Cashflow-Modellierung für die Zins- und Liquiditätsrisikosteuerung
- Zinsrisikomessung und Zinsrisikosteuerung
- Zinsrisikomanagement
- Liquiditätsrisikomanagement und Eigenkapitalsteuerung
- Fonds im Risikomanagement

### **Modul 3**

- Integrierte Marktpreisrisikosteuerung
- Fallstudie zur integrierten Gesamtbanksteuerung
- Praktische Übungen zum Treasury-Management
- Adressrisikomanagement
- Kreditrisikoprodukte

### **Termine**

Nr. 20

Modul 1 21.09. – 25.09.2020

Modul 2 30.11. – 04.12.2020

Modul 3 25.01. – 29.01.2021

Abschlusskolloquium 11.05.2021

Beginn am ersten Tag ist um 09:00 Uhr.

Das Ende am letzten Tag ist für 13:00 Uhr geplant.

### **Preise**

€ 1.450,- je Modul

€ 750,- für das Abschlusskolloquium

### **Dozenten**

externe Experten aus dem universitären bzw. Consultingbereich;

Mitarbeiter des Deutschen Sparkassen- und Giroverbandes und der Sparkassen-Finanzgruppe

### **Für weitere Informationen oder Fragen:**

Hannelore Schoen

Telefon: 0228 204 - 5899

Telefax: 0228 204 - 5862

eMail: [hannelore.schoen@dsgv.de](mailto:hannelore.schoen@dsgv.de)

Kirsten Klapheck

Telefon: 0228 204 - 5850

Telefax: 0228 204 - 5862

eMail: [kirsten.klapheck@dsgv.de](mailto:kirsten.klapheck@dsgv.de)