



Robert Bauer

Studieninhalte des Kurses Eigengeschäfte

ID 5646 Bewertung von Finanzinstrumenten in der Bankpraxis (mit DV-gestützten Übungsbeispielen)

Zinseszinsrechnung

Standardusancen am Geld- und Kapitalmarkt

Nominal- und Effektivverzinsung

Varianz, Standardabweichung, Kovarianz, Korrelation

Normalverteilung

Portfolio Selection und CAPM

Bewertung ausgewählter Zinsderivate

Anzahl Tage

3

ID 5647 Bond Management und Anlagestrategien

Inhaberanleihen

Namenspapiere

Strukturierte Emissionen

Quotierung/Preis eines Straight Bond

Risiken

Anleihebewertung und Renditekennzahlen

Strategien und Anleihemanagement

Anzahl Tage

2

ID 5069 Asset Allocation I – Grundlagen der Steuerung von Marktpreisrisiken

Grundlagen der Asset Allocation

Der strategische Investmentprozess der Asset Allocation als Grundlage für eine integrierte Risikostrategie

Fachliche Themen der Asset Allocation

- Performancemessung
- Risikomessung
- Asset-Klassen
- Risikoaggregation

Anzahl Tage

2

ID 5627 Aktienanlage im Depot-A als strategisches Investment

Ausgangspunkt und Zielsetzung der Portfoliotheorie

Übersicht der Ziel- und Steuerungsgrößen der Asset-Allocation

Effiziente Portfolios

Aufbau, Strukturierung und Management von Aktienportfolios in der Praxis

Anzahl Tage

2

ID 5648 Zinsderivate – Einsatzmöglichkeiten in Handel und Steuerung

Klassifizierung von Finanzderivaten

Formen des Handels mit Derivaten

Rechtliche Grundlagen des außerbörslichen Derivatehandels

Zinskonventionen

Bewertung von Derivaten

Risikomanagement (Zinsänderungsrisiko, Bonitätsrisiko)

Zinsderivate mit deterministischen Zahlungsströmen und ihre

Einsatzmöglichkeiten

Zinsderivate mit optionalen Zahlungsströmen und ihre Einsatzmöglichkeiten

Anzahl Tage

3

ID 5624 Zinsprognosen interpretieren und verstehen

Aktuelle Vorgänge - national und international

Die Zinsstruktur und ihre typischen Verläufe

Vorgehensweise bei der Zinsprognose

Analyse von Zinstrends und Zinsspreads

Analyse und Interpretation der Meinung anderer Häuser

Anzahl Tage

2

ID 5636 Rechtliche Rahmenbedingungen im Depot-A-Management

Mindestanforderungen an das Risikomanagement (MaRisk)

Risikotragfähigkeit

Handelsrecht

Solvabilitäts- und Liquiditätsverordnung, KWG

Sparkassenrecht

Anzahl Tage

4

ID 5625 Immobilienmärkte und Immobilien zur Eigenanlage

Funktionsweise von Immobilienmärkten

Immobilien als Anlageklasse Institutioneller Investoren

Steuerliche und bilanzielle Wirkungen auf die Sparkasse aus den unterschiedlichen Fondsrechtsformen)

Immobilienstrategie und Immobilienanlagestrategie

Integration von eigenen Immobilien und Immobilienanlagen in die
Gesamtbanksteuerung

Anzahl Tage

1

ID 5634 Steuerung des Zinsänderungsrisikos mit S-Treasury

Grundlagen der Treasury-Steuerung

Der Summen-Cash-Flow als Steuerungsbasis

Die Steuerung im Treasury-Ansatz - Fallstudie

Anzahl Tage

2

ID 5650 Workshop Eigengeschäfte

- S-Treasury aus Händlersicht
- Spezialfonds - Messung Risiko und Performance
- Zusatzerträge erzielen
- Spreadanalysen
- Refinanzierung am Geldmarkt
- Erarbeitung und Vorstellung einer Marktmeinung
- Inflationsanleihe
- Weitere aktuelle Themen

Anzahl Tage

2

ID 5608 Prüfung

Schriftliche Prüfung

Mündliche Prüfung

Anzahl Tage

2

Gesamtzahl der Tage

25