

The background of the entire page is a blurred image of a hand holding a silver pen, pointing towards a financial candlestick chart. The chart is overlaid with various technical indicators, including moving averages and trend lines, in shades of blue, orange, and red. The overall color palette is dominated by deep blues and purples.

ACADEMY

PORTFOLIO- UND RISIKOMANAGER

Zertifizierter
Praxislehrgang

START: 09. März 2020

PORTFOLIO- UND RISIKOMANAGER

Fixed-Income / Zins- / Kredit- / FX-Derivate und Strukturierte Finanzprodukte

ANSPRECHPARTNERIN



TANJA RÜCKHEIM

Referentin

Seminarmanagement

+49 228 8192-279

tanja.rueckheim@voeb-service.de

Im Frühjahr 2020 starten wir mit dem nächsten zertifizierten Praxislehrgang „Portfolio- und Risikomanager“, um im Rahmen einer tiefen Fortbildungsmaßnahme einen sicheren Umgang mit dem gesamten Instrumentenbaukasten derivativer Bausteine und der Fixed Income-Analyse zu gewährleisten. Die Ausbildungsreihe bietet eine kompakte Qualifizierungsmaßnahme, bei der die Kenntnisse vermittelt werden, die ein Anwender für die Praxis benötigt. Der Lehrgang kann aufgrund der jahrzehntelangen Praxiserfahrung des Dozenten und dem permanenten Einsatz von Bloomberg Professional® service während aller Seminar-Module als einzigartig im deutschsprachigen Raum angesehen werden. Erweitern und perfektionieren Sie Ihre theoretischen Kenntnisse, indem Sie gemeinsam mit dem Trainer über 12 Tage praxisnah die reale Welt des Portfolio- und Risikomanagements simulieren!

Der Lehrgang wird im Anschluss an die fünf Module an einem gesonderten Termin in einer zweistündigen Klausur geprüft. Der Lehrgangsleiter wird die Klausuren an Ort und Stelle sichten und bewerten, so dass das Zertifikat nach bestandener Prüfung unmittelbar ausgehändigt wird.

Für den Besuch der einzelnen Module sind keine speziellen Vorkenntnisse notwendig. Alle mathematischen und statistischen Grundlagen sowie Fachtermini werden an gegebener Stelle im jeweiligen Modul erläutert. Der Besuch von Modul 4 „Strukturierte Produkte/Financial Engineering“ setzt Kenntnisse aus den Derivate-Modulen 2 und 3 voraus und der Besuch von Modul 5 „Aktives Fixed-Income Portfoliomanagement“ setzt Kenntnisse aus Modul 1, 2 und 3 voraus. Die Module bauen aufeinander auf, insofern ist die modulare Abfolge der Seminare empfehlenswert. Gleichwohl können sie auch einzeln gebucht werden.

Lehrgangsleitung und Zertifizierung

Dozent und Lehrgangsleiter ist Christian Karl, der als ausgewiesener Experte für Fixed-Income, Derivate, Strukturierte Produkte und Portfoliomanagement seinen gesamten Erfahrungsschatz in Know-how und Didaktik einbringt, von der geschickten Verzahnung aller aufeinander aufbauender Module bis hin zur Verwendung einheitlicher Termini in einer komplexen, durch Anglizismen geprägten Finanzindustrie.

Die Zertifikatsübergabe erfolgt durch Christian Karl gemeinsam mit der Academy of Finance Bonn.

Zielgruppe

Der modular aufgebaute Praxislehrgang ist speziell konzipiert für Entscheidungsträger, Mitarbeiter/innen von Banken und Sparkassen, Investmentgesellschaften (KVGs), Versicherungen, Pensionskassen, Industrieunternehmen, insbesondere aus den Abteilungen

- Portfolio- und Fondsmanagement
- Asset Management/Vermögensverwaltung
- Bond- und Derivatehandel
- Treasury
- Risikomanagement
- Risikocontrolling
- Produktentwicklung und Financial Engineering
- Backoffice und Revision
- Wirtschaftsprüfung
- Softwareentwicklung

sowie Juniors bzw. Neueinsteiger in oben genannten Bereichen.

Modul 1: Fixed-Income Analyse/Bondanalyse

TERMIN & ORT

Preisbildung, Risikotreiber, Sensitivitäten
09. bis 10. März 2020 in Bonn

- Renditekonzept, Preisbildung von Geld- und Kapitalmarktinstrumenten
- Ertrags- und Spread-Kennzahlen, Horizon Return-Analyse
- Risikotreiber Zinsänderung, Ausfall, Bonitätsänderung und Liquidität
- Quantifizierung des Interest & Credit (Spread) Risikos mittels Sensitivitäten

Modul 2: Zins- und Währungsderivate

TERMIN & ORT

Zins- und FX-Swaps, Optionen, Futures
20. bis 22. April 2020 in Bonn

- Grundlagen, Definitionen und Charakteristika des Swap-Marktes
- Zinsswaps: Preisfindung, Simulation und Absicherungsstrategien verstehen
- Zinsoptionen: Swaptions, Caps & Floors und Volatilitäten
- Bewertung und Einsatz von Bondfutures im Risikomanagement
- FX-Derivate: Preisfindung, Simulation und Absicherungsstrategien verstehen

Modul 3: Kreditderivate und Corporate Bonds

TERMIN & ORT

Bonität, Rating, Credit Spreads, CDS
05. bis 06. Mai 2020 in Bonn

- Corporate Bonds: Risikotreiber und Quantifizierung Interest & Credit (Spread) Risk
- Basisstrukturen und Preisbildung von Kreditderivaten anhand von Praxisbeispielen
- Anwendungsmöglichkeiten von einfachen und komplexeren Kreditderivaten
- Pricing und Einsatz von Markit iTRAXX® Indices

Modul 4: Strukturierte Produkte/Financial Engineering

TERMIN & ORT

Zins-, Credit- und Inflations-Produkte
25. bis 26. Mai 2020 in Bonn

- Grundlagen und Basisbausteine Strukturierter Finanzprodukte
- Einfache und komplexe Strukturierte Zinsprodukte
- Zerlegung, Bewertung, Risikomessung und Simulation
- Inflation-Linked Bonds und Derivate: Pricing und Sensitivitäten

Modul 5: Aktives Fixed-Income Portfoliomanagement

TERMIN & ORT

Optimierung, Handelsstrategien und Steuerung von Zins-, Credit- und FX-Risiken
22. bis 24. Juni 2020 in Bonn

- Grundlagen der Strategischen und Taktischen Asset Allocation
- Fixed-Income Portfoliomanagement – Alles eine Frage des Stils
- Konstruktion, Analyse und Simulation von Zins- und Credit-Portfolios
- Szenario-Analysen mit Bonds/Zinsswaps/Futures/CDS
- Simulation von Handelsstrategien und Portfolio-Optimierung
- Risikomessung mit Value at Risk und Performancemessung

Prüfungstermine

TERMIN & ORT

25. Juni 2020 in Bonn

Kosten

5.850,00 EUR (umsatzsteuerfrei gemäß § 4 Nr. 22a UStG)
Die Gebühren für die Prüfung sind darin bereits enthalten.

Einzelpreise – alle Komponenten sind auch einzeln buchbar

Modul 1, 3 und 4: jeweils 1.340,00 EUR (umsatzsteuerfrei gemäß § 4 Nr. 22a UStG)

Modul 2 und 5: jeweils 1.950,00 EUR (umsatzsteuerfrei gemäß § 4 Nr. 22a UStG)

Realtime Anwendung von Bloomberg Professional® Service

Online-Einsatz von Bloomberg Professional® service

Die von weltweit ungefähr 360.000 Marktteilnehmern genutzte Finanzdienstleistung Bloomberg Professional® service wird von Christian Karl während der gesamten Ausbildungsreihe in Echtzeit eingesetzt. Somit werden nicht nur Inhalte begleitend intensiviert, sondern es wird auf Fragestellungen mit Simulationen lebendig und realitätsnah reagiert. Sie können die Gewissheit haben, dass Ihr erworbenes Know-how vor Ihren Augen in praxisnahes „Do-how“ übergeht.

Christian Karl ist seit 1990 Bloomberg-User und setzt das System seit 10 Jahren erfolgreich in seinen Seminaren ein. Positive Feedbacks unzähliger Teilnehmer bestätigen den immensen Mehrwert der sofortigen Veranschaulichung über Bloomberg.

Seminarunterlagen aus der Praxis für die Praxis

Die mit aktuellsten Inhalten und Screenshots illustrierten Seminarunterlagen dokumentieren detailliert die Vorgehensweise der Analyse und Bewertungsprozesse. Das durch den Lehrgang vermittelte Wissen kann daher an Ihrem Arbeitsplatz im täglichen Ablauf – auch noch Monate später – direkt am Bloomberg-Terminal repliziert und Step by Step umgesetzt werden. Die Teilnehmer erachten es als großen Mehrwert, wenn sie in der Nachbereitung anhand der strukturierten und über Jahrzehnte optimierten Seminarunterlagen die teils komplexen Fallbeispiele immer wieder spielerisch erfahren und nachbauen können.

Begleitende Umsetzung

Lassen Sie sich im Anschluss an die jeweiligen Module bzw. dem Lehrgang in Ihrer praktischen Umsetzung unterstützen und begleiten. Ihr Lehrgangleiter steht Ihnen in der Nachbearbeitung noch jeweils 4 Wochen online (nach Terminabsprache) für Fragen über Team Viewer zur Verfügung!

IHRE ANSPRECHPARTNERIN



TANJA RÜCKHEIM
Referentin Seminarmanagement
Tel.: +49 228 8192-279
tanja.rueckheim@voeb-service.de

INHALTLICHE BERATUNG



CHRISTIAN KARL
Seminare/Trainings/Consulting
Tel.: +43 664 4501655
karl@fixed-income.at

ANMELDUNG

BUCHUNGSHOTLINE: 0228 81 92-221

FAX: 0228 81 92-223

E-MAIL: ACADEMY@VOEB-SERVICE.DE

Portfolio- und Risikomanager

Zertifizierter Praxislehrgang

Lehrgangstart: 09. März 2020

Name/Vorname:

Position/Bereich:

Institut:

Anschrift:

Telefon/Telefax:

E-Mail:

Unterschrift:

Firmenstempel

Bitte senden Sie die Rechnung und Anmeldebestätigung an:

Name/Abteilung

Telefon/Fax

E-Mail:

Bedingungen

Der Lehrgang wird nach dem derzeitigen Stand der Technik sorgfältig vorbereitet und durchgeführt. Falls ein Seminar wegen Krankheit des Trainers, höherer Gewalt oder sonstiger unvorhersehbarer Ereignisse ausfällt, bieten wir Ihnen einen Ersatztermin an. Erfolgt keine Teilnahme oder sagt ein Teilnehmer binnen vier Wochen vor Lehrgangsbeginn ab, so wird die volle Gebühr erhoben. Selbstverständlich besteht die Möglichkeit, einen Vertreter zu benennen. Maßgebend ist der Eingang der schriftlichen Absage bei uns. Bis drei Wochen vor dem Veranstaltungsbeginn erhalten Sie die Rechnung / Bestätigung sowie einen Reiseplan und Hotelempfehlungen. Bitte buchen Sie erst nach Erhalt der Bestätigung Ihre Reise zum Veranstaltungsort! Die angegebenen Kontaktdaten werden im Sinne der geltenden Datenschutzerklärung erhoben und verarbeitet.



Godesberger Allee 88

53175 Bonn

Postfach 20 13 55

53143 Bonn

Telefax: +49 228 8192-223

E-Mail: academy@voeb-service.de