

ING

**PRÄSENZ-
SEMINAR**

06.05. -
07.05.25 und
04.11-05.11.25
wahrscheinlich
in Frankfurt

MODERNE ZINSBUCHSTEUERUNG IN DER PRAXIS

WIE SIE IHR GESAMTZINSBUCH ERFOLGREICH
STEUERN & BEWIRTSCHAFTEN

derivatexx



IN BANK
IN PANSRY

Gesamtzinbuch und Mehr!

Moderne Zinsbuchsteuerung in der Praxis

Dieses **Praxis-Seminar** ermöglicht Ihnen eine **umfassende detaillierte Auseinandersetzung** mit der Thematik Gesamtzinbuch in der Bank. Neben den Grundlagen der Zinsbuchsteuerung, werden passive, aktive & hybride Strategien und Ansätze behandelt, diskutiert und eingewertet. Natürlich inklusive Umsetzung und Finanzinstrumente. **Praxis im Vordergrund!**

Unser Angebot:

Moderne Zinsbuchsteuerung in der Praxis

"Zinsbuchsteuerung – Mehr als nur Cashflows und Swaps" | Zinsbuchsteuerung ist weit mehr als das bloße Ausrollen von Cashflows und das regelmäßige Nachsteuern via Zinsswaps im Sinne einer passiven Benchmark.

Die Zinsbuchsteuerung ist ein zentrales Instrument des bankbetrieblichen Risikomanagements, das sowohl die Ertrags- als auch die Substanzwertperspektive umfasst. In diesem Seminar werden die wesentlichen Risiken und die Bedeutung der Zinsänderungsrisiken in "ihren" Banken beleuchtet. Aufbauend auf den aufsichtsrechtlichen Anforderungen, wie den ICAAP, MaRisk & Basel III, und insbesondere betriebswirtschaftlichen Ansätzen, werden SIE die relevanten Methoden der Zinsbuchsteuerung & Bewirtschaftung praxisnah erlernen. Besonderer Raum werden dabei die Schwerpunkte "Stabilisierung periodischer Zinsüberschuss vs. barwertige Perspektive" einnehmen.

In diesem Seminar sprechen wir nicht nur über Zahlen und Modelle, sondern insbesondere auch darüber, was es bedeutet, das Zinsbuch als echten Erfolgsfaktor der Bank zu verstehen, zu steuern und zu bewirtschaften.

Es geht um Zinsmargengeschäft, Barwertsteuerung, aktive Monetarisierung und die professionelle Bewirtschaftung von Zinsänderungsrisiken. Wir beleuchten, wie Treasury-Teams das Zinsbuch nutzen können, um mehr zu erreichen als nur die Erfüllung regulatorischer Anforderungen.

Hier treffen sich Praktiker, die wissen, dass das Zinsbuch Herzstück und Kompass einer Bank sein kann – wenn man die richtigen Ansätze verfolgt. Ob aktive Steuerung, passives Zinskurvenmanagement oder hybride Strategien: Dieses Seminar bietet tiefgehende Einblicke, praxisnahe Tipps und jede Menge Raum für den Austausch unter erfahrenen Kollegen.

Für wen ist das Seminar gedacht? Für alle, die in Treasury, Gesamtbanksteuerung oder Risikomanagement arbeiten und sich mit den komplexen Anforderungen der Zinssteuerung täglich auseinandersetzen. Egal ob Spezialist oder Leiter – wir holen Sie dort ab, wo Sie stehen. Freuen Sie sich auf zwei Tage voller praxisnaher Inhalte, lebendiger Diskussionen und wertvoller Impulse – präsentiert von echten Praktikern.



Information

Aktuelle Marktentwicklung werden ins Seminar mit einbezogen



Sparring

Mehr als nur ein Seminar. Halten Sie auch nach dem Seminar Kontakt mit dem Referenten



Lösungen

Praxis gelebt | nicht doziert. Wir diskutieren auch aktuelle Herausforderungen und Lösungsansätze

Get in touch:

Dennis Bach | derivatexx GmbH
www.derivatexx.de | Mobil: 0160 311 8329



Online-Übungs-Seminar 07.01.2025

MODERNE ZINSBUCH- STEUERUNG IN DER PRAXIS

6. Mai 2025 - 7. Mai 2025 sowie 04. November - 5. November 2025

wahrscheinlich im TaunusTurm, Frankfurt a. M.

Dieses Seminar beleuchtet tiefgreifend die Zinsbuchsteuerung als zentrales Element des bankbetrieblichen Risikomanagements, das ZÜB & Barwert im Kontext -Ertrags- & Substanzwertperspektiven umfasst. Es geht um weit mehr als nur das passive Nachsteuern via Zinsswaps; wir diskutieren auch die aktive Monetarisierung und die professionelle Bewirtschaftung von Zinsänderungsrisiken. Teilnehmer lernen praxisnah, das Zinsbuch nicht nur zu verstehen, sondern es als echten Erfolgsfaktor zu nutzen, indem regulatorische Anforderungen übertroffen und verbesserte Ergebnisse erzielt werden. Themen umfassen Zinsmargengeschäft, Barwertsteuerung und innovative Zinskurvenmanagementstrategien. Dies ist eine ideale Plattform für Praktiker zum Austausch und zur Vertiefung ihrer Kenntnisse.

Dieses **DERIVATEXX Seminar** ermöglicht Ihnen eine umfassende detaillierte Auseinandersetzung mit der Thematik Steuerung & Bewirtschaftung des Gesamtzinbuches ihrer Bank.

KERNINHALTE

- Grundsätzliche Methodik Gesamtzinbuch
- Aktiv, passiv, hybrid oder "Alles?"
- Praktische Ableitung & Handlungsansätze
- Zinsbuchsteuerung mit Zinsswaps & Optionen
- Strategien & Absicherung in der Praxis
- Handlungsoptionen im aktuellen Umfeld

REFERENT



Dennis Bach
derivatexx GmbH

Veranstaltungsort

TaunusTurm
Taunustor 1
60310 Frankfurt

Seminarzeiten

Di. 11. und Mi. 12. März 2025
Beginn: 10.00 Uhr
Ende: 18.00 Uhr (1.Tag) | 17.30 Uhr (2.Tag)

Teilnahmegebühr

EUR 1.995,00 zzgl. 19% MwSt.
Der Preis versteht sich einschließlich umfangreicher Kursunterlagen, Mittagessen und Erfrischungen

Information und Anmeldung

Nähere Informationen unter
<http://www.derivatexx.de>
Email: dennis.bach@derivatexx.de
Tel: +49 (0) 7033 406 7 11

MODERNE ZINSBUCH- STEUERUNG IN DER PRAXIS

Seminarinhalte 1. Tag

Warming-Up

- Die Ausgangslage: Zinsbuch und Zinsbuch?
- Einführung in die (moderne) Zinsbuchsteuerung, aktuelle Herausforderungen
- Zielsetzung: Von der Theorie zur Praxis ...

Passivstrategien: Benchmark und Hebel im Fokus

- Benchmark-Ansätze in der Passivsteuerung
- Vom Cashflow zum Zinsbuch
- Vergleich mit Marktbenchmarks: Risiken und Chancen
- Anwendung von Benchmarking bei Sichteinlagen und Spareinlagen

Hebelwirkungen im Zinsbuch - Leverage Lie?

- Hebelwirkungen im Zinsbuch
- Bedeutung des Leverage bei der Fristentransformation
- Beispiele aus der Praxis für optimierte Zinsüberschüsse

Passive Zinsbuchsteuerung: Stabilität und Effizienz

- Steuerung des Zinsüberschusses durch Passivstrategien
- Integration von Sichteinlagen und Ablaufifikationen in die Fristentransformation
- Barwertige Risikoperspektiven bei passiven Strategien

Aktive Zinsbuchstrategien

- Fristentransformation und aktive Steuerung:
- Nutzung von Zinsstrukturkurven: Steepener/Flattener-Strategien
- Optimierung durch Szenarioanalysen

Das Maß aller Dinge?

- ZÜB, JÜ und Minimaler ZÜB - Das richtige Maß der Zinsfristentransformation
- Korrelationseffekte Zinsbuch vs. den Rest der Bank

Instrumente im Fixed Income- & Bondmanagement

- Geld- & Kapitalmarktprodukte im Fixed-Income – Zusammenhänge verstehen
- Die Differenzierung der einzelnen Produktkategorien
- Die Verzahnung und Wirkungsketten von Produkt, Zinskurve und Hedge
- Replikation und Hedge – viele Wege führen nach Rom

Seminarinhalte 2. Tag

Methoden, Instrumente und praktische Umsetzung

- Rückblick auf Tag 1 und Fragen
- Moderne Methoden in der Zinsbuchsteuerung
- Barwert- & GuV-Perspektiven im Vergleich
- Steuerungsinstrumente für variable Produkte und Ablaufifikationen
- Modellierung und Steuerung von Risiken: Value-at-Risk und Sensitivitätsanalysen im Zinsbuch

Finanzinstrumente in der Praxis

- Integration außerbilanzieller Instrumente in das Zinsbuchmanagement
- Einsatz von Derivaten in der Fristentransformation: Swaps, Swaptions, Caps & Floors
- Bewertung und Backtesting von Derivaten im Zinsbuch

Markttrends in der Steuerung

- Auswirkungen der Marktphasen auf die Zinsbuchsteuerung
- Regulatorische Anforderungen (ICAAP, MaRisk)

Entwicklung institutsspezifischer Zinsbuchstrategie

- Analyse der eigenen Zinsbuchposition
- Entwicklung einer passgenauen Strategie für passive, aktive und hybride Ansätze

Fallstricke in der Praxis

- Hindernisse & Hemmnisse in der Steuerung des Zinsbuches
- Beseitigung & Weiterentwicklung der Steuerung
- Von der Steuerung zur integrierten Bewirtschaftung
- Austausch und Feedback im Plenum| Abschluss und Ausblick

MODERNE ZINSBUCH- STEUERUNG IN DER PRAXIS

Anmeldeformular



Ja, ich möchte teilnehmen!



am derivatexx Seminar | **Moderne Zinsbuchsteuerung in der Praxis** | am **6. und 7. Mai** oder **4. und 5. November 2025** | Teilnahmegebühr **EUR 1.995,-** zzgl. 19% MwSt.

**ALTERNATIV: BUCHUNGSLINK AUF UNSERER
WEBSITE!**

Name	Vorname
Abteilung	Funktion
Firma	
Straße	PLZ, Ort
Telefon	Email
Datum/ Unterschrift/ Firmenstempel Wir bestätigen hiermit die Übernahme der Kosten des/der von uns angemeldeten Teilnehmer	

ANMELDEBESTÄTIGUNG

Innerhalb von 7 Tagen bestätigen wir Ihnen den Erhalt Ihrer Anmeldung. Wir weisen darauf hin, dass wir Ihnen die finale Anmeldebestätigung mit der Rechnung ca. 4 Wochen vor Veranstaltungsbeginn zusenden werden. Bitte berücksichtigen Sie dies bei Ihren Planungen.
Bei Stornierung der Anmeldung bis 21 Tage vor Seminarbeginn, erheben wir eine Bearbeitungsgebühr in Höhe von 10% der Teilnahmegebühr. Bei späteren Absagen wird die halbe Kursgebühr in Rechnung gestellt. Erfolgt die Abmeldung erst in den letzten 10 Tagen vor Kursbeginn, müssen wir die gesamte Kursgebühr berechnen. Eine Vertretung des angemeldeten Teilnehmers ist möglich.

Für den Fall, dass wir die Veranstaltung absagen müssen, erstatten wir die gezahlte Kursgebühr vollständig zurück. Weitergehende Ansprüche sind ausgeschlossen.

Seminarort

Veranstaltungsort ist der TaunusTurm in Frankfurt,
Adresse: TaunusTurm, Taunustor 1, 60310 Frankfurt,

Die Kosten für Übernachtung sind nicht in der Teilnahmegebühr enthalten.

Informationen und Anmeldung

derivatexx GmbH | Königstrasse 38 | 70173 Stuttgart
Email: dennis.bach@derivatexx.de | Telefon: +49 (0) 7033 406 7 111