

Toetstermen DSI Informeren Treasury

1.
Kandidaat kan gegeven een valutakoers bepaalde hoeveelheid van een valuta omrekenen in een bepaalde hoeveelheid van een andere valuta.
2.
Kandidaat kan het verschil uitleggen tussen een contract exposure, een cash flow exposure en een balansexposure in het kader van valutarisicobeheer en van prijsrisicobeheer van grondstoffen
3.
Kandidaat kan het verschil uitleggen tussen valutarisico in het offertestadium en valutarisico nadat een offerte is geaccepteerd en kan aangeven op welke drie manieren ondernemingen met valutarisico om kunnen gaan
4.
Kandidaat kan de werking van een FX forward (valutatermijnaffaire) uitleggen en kan toepassingen aangeven van FX forwards
5.
Kandidaat kan de werking van een ndf uitleggen en kan kwalitatief aangeven hoe een gegeven ndf contract bij een gegevens spotkoers op de einddatum wordt afgewikkeld
6.
Kandidaat kan uitleggen welke optie ondernemingen gebruiken om zich in te dekken tegen een koersstijging/koersdaling en kan aangeven bij welke koersen op de expiratedatum van een optiecontract een onderneming besluit om een gegeven optie uit te oefenen
7.
Kandidaat kan de effectieve koers berekenen op de einddatum van een optiecontract gegeven de uitoefenprijs en de spotkoers op expiratedatum
8.
Kandidaat weet uit welke opties een cilinderstrategie kan bestaan
9.
Kandidaat kan het voordeel en het nadeel van een cilinderstrategie noemen in vergelijking tot het uitsluitend kopen van een optie
10.
Kandidaat kan uitleggen hoe een onderneming zich door middel van een renteswap kan indekken tegen het renterisico op een variabel rentende lening en kan uitleggen wat de gevolgen zijn van vervroegd aflossen
11.
Kandidaat kan uitrekenen wat het effectieve vaste rentepercentage is dat een onderneming per saldo betaalt als zij zowel een variabel rentende lening heeft als een renteswap

12.

Kandidaat kan uitleggen hoe een cap werkt en kan het voordeel en het nadeel van een cap noemen in vergelijking tot een renteswap en tot het openlaten van de positie

13.

Kandidaat kan uitleggen welke opties samen een collar vormen, hoe een collar werkt en kan het voordeel en het nadeel van een collar noemen in vergelijking tot een cap en een renteswap

14.

Kan aangeven wat bij uiteenlopende rentes op fixingmomenten de rentekosten zijn bij gebruik van een cap en een collar en wat de maximale effectieve rentekosten zijn gedurende de looptijd van de hedge

15.

Kandidaat kan het verschil uitleggen tussen Commodity futures en OTC forwards, tussen fysieke levering en cash settlement en kan uitleggen hoe de afwikkeling van de verschillende OTC commodityderivaten plaatsvindt

16.

Kandidaat kan aangeven in welke situaties commodityforwards / futures, commodityswaps, commodity caps, floors of collars geschikt zouden kunnen zijn

17.

Kandidaat kent de kenmerken en toepassingsmogelijkheden van een FX Swap

18.

Kandidaat kan aangeven hoe een termijnaffaire kan worden doorgerold door middel van een valutaswap en kan aangeven hoe een onderneming eurofunding kan aantrekken door een combinatie van een lening in andere valuta en een valutaswap

19.

Kandidaat kan het verband uitleggen tussen rentever verschillen en swappunten

20.

Kandidaat kan aangeven onder welke omstandigheden sprake kan over- of onderdekking en wat hiervan de gevolgen zijn

21.

Kan aangeven welke treasuryproducten onder MiFIDII vallen en kan de factoren omschrijven die het complexiteitsniveau van financiële instrumenten bepalen.

22.

kandidaat kan de pijlers van het treasurybeleid en cashmanagement omschrijven en begrijpt het belang van risicodekking door de klant

23.

kandidaat weet welke factoren in het algemeen de rentetypische, liquiditeitstypische en valutaire mismatch van ondernemingen, pensioenfondsen en banken bepalen en kandidaat kan omschrijven welke risico's beheerd worden bij de treasury van ondernemingen.

24.

Kandidaat kan richting klanten de kostenstructuur duiden die de bank hanteert bij haar diensten en producten

25.

Kandidaat kent de definitie van 'aanbeveling' in MIFID2

26.

Kandidaat kan het onderscheid maken tussen de dienstverleningsconcepten 'execution only', 'advies' en 'beheer'

27.

Kandidaat kan de standaardregels met betrekking tot klantclassificatie uit MiFID 2 toepassen

28.

Kandidaat weet wanneer hij een passendheidstoets moet afnemen en wanneer hij een geschiktheidstoets moet afnemen.

28.

Kandidaat kan duidelijk onderscheid maken tussen zijn plichten voor professionele klanten enerzijds en niet-professionele klanten anderzijds.

29.

Kandidaat weet wat een yieldcurve is, kan de vorm van een yieldcurve duiden en kan globaal een implied forward yield uitrekenen

30.

Kandidaat kan de klant in algemene termen uitleggen hoe de prijsvorming tot stand komt van de financiële instrumenten die de bank aanbiedt en begrijpt het belang in het algemeen van periodieke herijking van door klanten gehanteerde financiële instrumenten of diensten aan profielen van klanten.

31.

Kandidaat kent de deelmarkten en begrijpt in grote lijnen hoe financiële markten werken. Kandidaat kan de invloed duiden van economische data en (geo)politieke gebeurtenissen op

financiële markten en op de waarde van veelgebruikte financiële instrumenten en - producten.

32.

Kandidaat kan in algemene bewoordingen uitleggen hoe het door centrale banken gevoerde monetair beleid medebepalend kan zijn voor het verloop van korte en lange rente en valutakoersen.

33.

Kandidaat kan in algemene bewoordingen de impact beschrijven van de Bazel regelgeving op derivaten

34.

Kandidaat kent de kenmerken van de belangrijkste rente benchmarks (EONIA, €STER en SOFR) en kan in algemene bewoordingen uitleggen waarom benchmarkhervormingen zijn doorgevoerd en de impact die het heeft op financiële ondernemingen en cliënten.

35.

Kandidaat kan de invloed van de waardeparameters van financiële instrumenten inschatten

36.

Kandidaat kan een de waarde van een valutatermijnaffaire berekenen en een beredeneerde inschatting geven van de waarde van een renteswap

37.

Kandidaat kan het verband uitleggen tussen de waarde van een financieel instrument en het kredietrisico dat de bank loopt uit hoofde van dit instrument

38.

Kandidaat kan in algemene bewoordingen de impact van klimaatrisico's op financiële producten uitleggen.

39.

Kandidaat kent de actuele regelgeving en leidraden ten aanzien van marktmisbruik en anti-witwas maatregelen, kent de procedures om mogelijke situaties van marktmisbruik of witwassen binnen de organisatie kenbaar te maken en is bekend met de reikwijdte van de sanctielijst.

40.

kandidaat kent de inhoud van en kan de klant inzicht verschaffen in standaarddocumentatie die representatief is voor door klanten in het algemeen gehanteerde financiële instrumenten

41.

kandidaat kent de richtlijnen voor de communicatie rondom het orderuitvoeringsbeleid van de bank waar hij/zij werkzaam is en kent de principes van de best execution regels in MiFID

42.

Kandidaat kent op hoofdlijnen de inhoud van de Europese Benchmarkverordening

43.

kandidaat kent op hoofdlijnen de implicaties van EMIR voor de dienstverlening die de bank aanbiedt

44.

Kandidaat kent de hoofdlijnen van de gangbare waarderingsmethoden, zoals IFRS en USGAAP.