

ACI Operations Certificate (002-200)

Musterfragen

*“Setting the benchmark in
certifying the financial
industry globally”*

ACI - The Financial Markets Association
8 Rue Du Mail
75002 Paris France
www.acifma.com

1 – Gesamtfinanzmarkt und Front-to-End Handelsüberblick

1.1 Was bedeutet „modified preceding business day convention“?

- A eine Vereinbarung wodurch die Valuta eines Geschäfts der vorhergehende Bankarbeitstag ist
- B→** eine Vereinbarung wodurch die Valuta einer Transaktion der Bankarbeitstag ist, es sei denn dieser Tag fällt in den vorigen Monat. In diesem Fall ist es der nächste Bankarbeitstag
- C eine Vereinbarung wodurch die Valuta eines Geschäfts der erste nachfolgende Bankarbeitstag ist
- D eine Vereinbarung wodurch die Valuta einer Transaktion der erste vorhergehende Bankarbeitstag, der auf den gleichen numerischen Tag fällt wie die vorangegangene Zahlung

1.2 An welchen Referenzsatz ist die variable Seite eines JPY Overnight Index Swaps (OIS) gebunden?

- A TANIA
- B SONIA
- C→** TONAR
- D CHOIS

2 - Geschäftserfassung, Eingabe und Bestätigungen

2.1 Wozu würden Sie eine SWIFT-Nachricht MT 340 anwenden?

- A um eine vanilla Devisenoption zu bestätigen
- B um eine Devisenhandels-Transaktion zu bestätigen
- C um die Vertragsbedingungen einer Geldmarkt-Anlage/-Aufnahme zu bestätigen
- D→** um die Details eines Forward Rate Agreement (FRA) zu bestätigen

2.2 Im Lebenszyklus einer Transaktion ist die Geschäftseingabe eine Aufgabe:

- A→** der Front Office Mitarbeiter
- B der Operations Mitarbeiter
- C der Middle Office Mitarbeiter
- D der Back Office Mitarbeiter

3 - Abwicklung, Netting und Clearing

3.1 In welchem Land wird das „SIC-System“ angewendet, um sowohl Großbetragszahlungen als auch Massenzahlungen abzuwickeln?

- A Schweden
- B China
- C→** Schweiz
- D Singapur

3.2 Was ist in CHAPS die Schlusszeit für den Empfang von Valuta heute einwärts Zahlungen per MT 202?

- A 16:00 Uhr (4:00 p.m. London Zeit)
- B 16:05 Uhr (4:05 p.m. London Zeit)
- C→** 16:20 Uhr (4:20 p.m. London Zeit)
- D 16:30 Uhr (4:30 p.m. London Zeit)

4 - Abstimmungen und Ermittlungen

4.1 Welches der folgenden ist ein Beispiel eines Vostro (Loro) Kontos aus der Sicht einer Bank in Zürich?

- A ein CHF Konto, das sie bei einer anderen Bank in Zürich unterhält
- B ein Fremdwährungskonto, das sie bei einer anderen Bank in Zürich unterhält
- C ein Fremdwährungskonto, das sie bei einer anderen Bank außerhalb der Schweiz unterhält
- D→** ein CHF Konto, das sie für einen Kunden in Luxemburg führt

4.2 Auf einem Ihrer beiden JPY Nostrokonten sind Sie JPY 2,500,000,000 lang (long) und auf dem anderen JPY 2.500.000,000 kurz (short). Welche Maßnahmen sollten Sie bei der Abstimmung ergreifen?

- A→** Sie sollten die Bank, bei der Sie long sind anweisen, JPY 250.000.000 auf Ihr Nostrokonto bei der anderen Bank zu übertragen
- B Anlage der überschüssigen JPY 2.500.000.000 an um mit dem Zinsertrag aus diesem Geschäft die Überziehungszinsen des Sollsaldos auszugleichen
- C Es ist keine Maßnahme erforderlich. Die Sollzinsen des überzogenen Kontos werden sich mit den Habenzinsen des anderen Kontos ausgleichen
- D Sie sollten JPY 2.500.000.000 aufnehmen um das Sollsaldo auf dem einen Konto zu decken und belassen den Habensaldo auf dem anderen Konto

5 – Treasury-Systeme und Datenmanagement

5.1 Welche Buchstaben bilden den Ländercode in einer BIC-Adresse unter ISO-Standard 9362:2009?

- A die beiden ersten Buchstaben
- B die 4 ersten Buchstaben
- C der 3. und 4. Buchstabe
- D→** der 5. und 6. Buchstabe

5.2 Wofür steht die Abkürzung „IBAN“?

- A International Bank Access Number
- B Independent Basel Accords Newsgroup
- C→** International Bank Account Number
- D Independent Bank Auditors Network

6 - Risikomanagement, Kontrollen, Compliance und Dokumentation

6.1 Wer trägt die Verantwortung für das Gewährleisten einer ordnungsgemäßen Funktionsweise und Integrität der Finanzmärkte sowie für die Stabilität des Finanzsystems in der EU?

- A die FSA in London
- B→** die EBA in London
- C die EBF in Brüssel
- D die EZB in Frankfurt

6.2 Welches der folgenden bildet das Ziel der “FATF” (auch noch bekannt unter dem französischen Kürzel “GAFI”)?

- A→** Das Einrichten von Maßstäben und das Fördern einer effektiven Umsetzung der rechtlichen, regulatorischen und operativen Maßnahmen zur Bekämpfung von Geldwäsche, von Terrorismusfinanzierung und von anderen Bedrohungen für die Integrität des internationalen Finanzsystems
- B Der Schutz der Anleger, das Pflegen von fairen, geordneten und effizienten Märkte sowie die Vermögensbildungsförderung
- C Dem Schutz und der Verbesserung der Stabilität des britischen Finanzsystems beizutragen und das Ausmaß zu reduzieren, dass ein reguliertes Unternehmen zwecks Finanzkriminalität ausgenutzt wird
- D Das Aufrechterhalten professioneller Kompetenzen und ethischen Loyalitätsstandards, die für den Aufbau von internationalen Beziehungen unerlässlich sind, und die nach Möglichkeit zu erbringende gegenseitige Beihilfe

7 - Devisenhandel

7.1 Ihr Devisenhändler hat 12.000.000,00 USD/CHF Kassa zu 0.9325 gekauft. Bei der Abwicklung dieses Geschäfts werden Sie:

- A CHF 12.868.632,71 erhalten
- B CHF 12.868.632,71 zahlen müssen
- C CHF 11.190.000,00 erhalten
- D→ CHF 11.190.000,00 zahlen müssen**

7.2 Am Donnerstag den 5. Mai wurde ein tom next EUR/JPY FX Swap gehandelt. Was ist die Valuta der Kassa- und der Terminseite des FX Swaps, vorausgesetzt in der Woche vom 9. Auf den 16. Mai gibt es in den relevanten Währungen keine Bankfeiertage?

- A 5. Mai – 6. Mai
- B 6. Mai – 7. Mai
- C→ 6. Mai – 9. Mai**
- D 9. Mai – 10. Mai

8 - Geldmarkt

8.1 Welche Zinsberechnungsmethode wird im Interbank-Depotgeschäft für ZAR, SGD und HKD angewandt?

- A ACT/ACT
- B→ ACT/365**
- C ACT/360
- D 30/365

8.2 Ihr Geldmarkthändler hat ein Interbank-Depot über ZAR 25.000.000,00 zu 5,00% für 6 Monate (183 Tage) entgegengenommen. Welcher Betrag (Kapital plus aufgelaufene Zinsen) werden Sie bei Fälligkeit zurückzahlen müssen?

- A 626,712.33
- B 635,416.67
- C→ 25,626,712.33**
- D 25,635,416.67

9 – Derivative

9.1 Welchen Referenzzinssatz würde üblicherweise verwendet werden, wenn ein EUR FRA zwischen zwei Banken in Singapur abgewickelt würde?

- A SIBOR
- B Euro LIBOR
- C→** EURIBOR
- D EONIA

9.2 Welches der folgenden Derivate wird nie außerbörslich gehandelt?

- A→** Financial Futures
- B Zinsswaps (IRS)
- C Forward Rate Agreements
- D Devisenoptionen

10 - Kurzfristige Anleihen und Schuldscheine

10.1 In einem Szenario, in dem kurzfristige Zinssätze höher als langfristige sind, würde die Zinskurve als:

- A→** fallend bezeichnet werden
- B steil bezeichnet werden
- C steigend bezeichnet werden
- D flach bezeichnet werden

10.2 Mit welchen Laufzeiten werden US Treasury Bills üblicherweise ausgestellt?

- A bis zu 2 Jahren
- B nur für 4 Wochen
- C 1 Monat, 2 Monate und 3 Monate
- D→** 4 Wochen, 13 Wochen, 26 Wochen und 52 Wochen