

[K19-P02] Strukturierte Produkte – Regulierung KAGB, Bewertung, Zerlegung

Seminarinhalte

Inhalte des Seminars sind die Erläuterung der Funktionsweise der verschiedenen Kreditverbriefungen etc. Im Fokus des Seminars steht die Erwerbbarkeit der Produkte für den Fonds und die Risikobetrachtung aus Sicht des Fonds. Das Grundprinzip der Bewertung solcher Produkte und der preisbildenden Parameter runden das Seminar ab.

Kreditverbriefungen, Kreditderivate und Strukturierte Finanzprodukte

- Definition Kreditverbriefungen und Kreditderivate
 - ABS: Komponenten und Akteure
 - CDO: Tranchen und Kreditrisiko
 - CLN: Struktur und Ereignisse
 - CDS: Struktur und Nutzung
- KAGB, ESMA, VAG/AnIV
- Zerlegung und Anrechnungsbetrag

Grundlagen der Bewertung von Derivaten (Optionen)

- Renditekurven, Barwert, Zerobond-Abzinsungsfaktoren
- Optionspreistheorie, Optionsbewertungsmodelle

Bewertung von Derivaten (Optionen) mit Anleihen Exotische Optionen

- Pfad-, grenzwertabhängig, etc.
- CAP - Caplets/Bewertung
- Floor, Collar

Forward Rate Agreements Einfache Strukturierte Produkte

- DTG, NDF
- Aktienforwards

Zielgruppe

- Mitarbeiter im Investment- und Risikocontrolling
- Mitarbeiter in der Fondsbuchhaltung

Vorkenntnisse: Grundkenntnisse Investmentfonds, Derivate

Seminararten: Dauer: 1 Tag
Preis: EUR 1.050 (+ MwSt.)
Teilnehmer: maximal 10

Termine: 01. April 2019
04. November 2019