

[K18-Co1] Investmentcontrolling nach KAGB

Gesetze und Verordnungen inkl. europäischer Vorgaben

Seminarinhalte

Dieses 2-tägige Intensivseminar festigt und vertieft die Kenntnisse zu den Anlagegrenzen und Risikovorgaben des Kapitalanlagegesetzbuchs und begleitender Verordnungen der BaFin und der EU. Die Teilnehmer lernen die aus dem Gesetz resultierenden Umsetzungen bis auf die operative Ebene in anwendbare Formeln kennen. Die Teilnehmer werden für unterschiedliche Auslegungen anhand praktischer Beispiele sensibilisiert.

Rechtlicher Rahmen

- EU und deutsche Gesetzgebung
- Neue Begriffe und Regulierungen KAGB 2016
- Anlagegrenzen OGAW
- Anlagegrenzen spezieller Investmentvermögen - (OGAW-Geldmarktinvestmentvermögen, OGAW-Dachfonds, offene gemischte Investmentvermögen, offene sonstige Investmentvermögen, offene AIFs in Form v. Spezialsondervermögen mit festen Anlagebedingungen)

Prüfsystematik

- Regelgruppen, Regelstruktur, Regelteile, Regellogik, Organisation
- Beispiele zu den Regel- und Verletzungskategorien
- 'anzurechnender Wert'

Anlagegrenzen im KAGB

- Zulässige Vermögensgegenstände und deren Grenzen
- Sonstige Anlageinstrumente
- Kreditaufnahme, WPL, Repo
- Emittentengrenzen, Stimmrechte
- Erweiterte Anlagegrenzen für spezielle Fondsarten
- AIFMD, ESMA 231/2013 und die Regulierung von Spezial-AIF

DerivateV und Risikomanagement

- Derivateverordnung
- KAVerOV , ESMA OGAW Guidelines
- Prinzipien und Struktur
- Kredit-/ Marktrisiko, Value at Risk
- Leverage/Hebel für AIF und OGAW
- Zerlegung: Strukturierte/verbriefte Derivateprodukte

Risikomanagement & Organisation

- Strategie und Aufgaben der Risikokontrolle
- Konzept der Risikokontrolle
- Liquiditätsrisiko, Liquiditätsstresstest

Exkurs

- KVG Verhalten, Interessenkonflikte, Organisationspflichten,
- KVG Risikomanagement, Liquiditätsmanagement
- Organis. Anforderungen an eine unabhängige Bewertung
- KVG Leverage/Hebelfinanzierung
- KVG Auslagerung
- Anforderungen an die Bewertung der Investmentvermögen

Zielgruppe

- Mitarbeiter im Fondscontrolling

Vorkenntnisse: Wissen Wertpapiere & Derivate
Grundkenntnisse Fonds

Seminardaten:

Dauer: 2 Tage
Preis: EUR 1.595 (+ MwSt.)
Teilnehmer: maximal 12

Termine:

05.-06. März 2018
19.-20. November 2018