

## [K18-P02] Kreditverbriefungen, Kreditderivate und Strukturierte Finanzprodukte

### 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
- Regulierung der Produkte im Fonds
- 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:** Investmentfonds, Derivate

**Seminararten:** Dauer: 1 Tag  
Preis: EUR 995 (+ MwSt.)  
Teilnehmer: maximal 8

**Termine:** 05. November 2018