

## Banking & Finance: Derivate II & Strukturierte Produkte II

Bildungsangebot VSV

Titel / Thema	Derivate II & Strukturierte Produkte II
Zielgruppe	Vermögensverwalter
Lerninhalte	<p>Das Thema fokussiert die Berechnung von Optionswerten und die Interpretation wichtiger Optionskennzahlen. Ausserdem werden verschiedene Optionsstrategien aus Kundensicht und Exotische Optionen vorgestellt.</p> <p>Im Thema Strukturierte Produkte werden die vier grundlegenden Kategorien – Kapitalschutzprodukte, Renditeoptimierungs-Produkte, Partizipations-Produkte und Hebel-Produkte – vorgestellt und ihre grundlegenden Unterschiede veranschaulicht. Anhand konkreter Praxisbeispiele werden spezifische Produkttypen innerhalb der vier Produktkategorien im Einzelnen vertieft erläutert.</p>
Lernort / Testingort	Fintelligence Online Lernplattform: <a href="https://fintelligence.fintelligence-net.com/">https://fintelligence.fintelligence-net.com/</a>
Lerndauer	<p><u>Derivate II</u></p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Optionskennzahlen (90 min)</li><li>2. Optionsstrategien I (70 min)</li><li>3. Optionsstrategien II (80 min)</li><li>4. Exotische Optionen (60 min)</li><li>5. Lernkontrolle (70 min)</li></ol> <p><u>Strukturierte Produkte II</u></p> <ol style="list-style-type: none"><li>6. Kapitalschutz-Produkte (70 min)</li><li>7. Renditeoptimierungs-Produkte (60 min)</li><li>8. Partizipations-Produkte (70 min)</li><li>9. Hebel-Produkte (70 min)</li><li>10. Lernkontrolle (80 min)</li></ol>
Normlaufzeit	2 Monate
Lernziele	<p><u>Derivate II</u></p> <p><u>Optionskennzahlen</u></p> <p>Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben, können Sie</p> <ul style="list-style-type: none"><li>• die Unterschiede zwischen statischen und dynamischen Kennzahlen von Optionen erläutern,</li></ul>

- die wichtigsten statischen Kennzahlen von Optionen benennen und ihre Bedeutung erklären,
- die Wichtigkeit von dynamischen Kennzahlen bei der Bewertung von Optionen darlegen,
- Optionen anhand von verschiedenen dynamischen Kennzahlen beurteilen,
- die am häufigsten verwendeten dynamischen Kennzahlen anhand von Beispielen erläutern.

#### Optionsstrategien I

- Sie können die vier grundlegenden Optionsgeschäfte (Kauf und Verkauf von Calls bzw. von Puts) entsprechend den Kundenwünschen einsetzen
- Sie wissen über die unterschiedlichen Anlegermotive für Geschäftsabschlüsse in Optionen Bescheid und können sie Ihren Kunden darlegen
- Optionsstrategien entsprechend der Preisentwicklung des Basiswertes und der Entwicklung der Volatilität des Basiswertes einordnen
- Sie können wichtige Absicherungsstrategien, wie den Protective Put und den Long Call Hedge, erklären
- Sie verstehen gängige Strategien der Renditeoptimierung, insbesondere Covered und Uncovered Call Writing sowie Naked Put Writing

#### Optionsstrategien II

- Sie können die vier grundlegenden Optionsgeschäfte (Kauf oder Verkauf von Calls bzw. Puts) entsprechend den Kundenwünschen einsetzen
- Sie wissen über die unterschiedlichen Anlegermotive für Geschäftsabschlüsse in Optionen Bescheid und können sie Ihren Kunden darlegen
- Sie können Optionsstrategien entsprechend der Preisentwicklung des Basiswertes und der Entwicklung der Volatilität des Basiswertes einordnen
- Sie können darstellen, wie gängige Renditesteigerungsstrategien umgesetzt werden und ihre Risiko-Rendite-Merkmale erläutern
- Sie wissen über den Leverage-Begriff in Zusammenhang mit Optionen Bescheid
- Sie verstehen den Einsatz von Optionen aus Sicht der Portfoliodiversifikation

#### Exotische Optionen

- Sie können die Hauptmerkmale der gängigsten exotischen Optionen erklären
- Sie sind in der Lage, die Risiko-Rendite-Merkmale von exotischen Optionen zu erläutern

- Sie verstehen die Einsatzmöglichkeiten von exotischen Optionen und können Sie einem Kunden darlegen

### Strukturierte Produkte II

#### Kapitalschutz-Produkte

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- kennen Sie die vier Arten von Kapitalschutz-Produkten gemäss der Derivative Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte (SVSP) und können sie voneinander abgrenzen,
- kennen Sie die wesentlichen Konstruktionsmerkmale und Funktionsweise von Kapitalschutz-Produkten sowie die Markterwartungen des Anlegers,
- kennen Sie die Chancen und Risiken der Kapitalschutz-Produkte,
- wissen Sie insbesondere über die Kapitalschutz-Produkte mit Partizipation und mit Coupon detailliert Bescheid.

#### Renditeoptimierungs-Produkte

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- kennen Sie die fünf Arten von Renditeoptimierungs-Produkten gemäss der Derivative Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte SVSP und können sie voneinander abgrenzen,
- kennen Sie die wesentlichen Konstruktionsmerkmale und Funktionsweise von Renditeoptimierungs-Produkten sowie die Markterwartungen des Anlegers,
- kennen Sie die Chancen und Risiken der Renditeoptimierungs-Produkte,
- wissen Sie insbesondere über die Reverse Convertible und Barrier Reverse Convertible detailliert Bescheid.

#### Partizipations-Produkte

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- kennen Sie die fünf Arten von Partizipations-Produkten gemäss der Derivative Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte (SVSP) und können sie voneinander abgrenzen,
- kennen Sie die wesentlichen Konstruktionsmerkmale und Funktionsweise von Partizipations-Produkten sowie die Markterwartungen des Anlegers,
- kennen Sie die Chancen und Risiken der Partizipations-Produkte,
- wissen Sie insbesondere über Tracker und Bonus Zertifikate detailliert Bescheid.

	<p><u>Hebel-Produkte</u></p> <p>Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• kennen Sie die fünf Arten von Hebel-Produkten gemäss der Derivative Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte (SVSP) und können sie voneinander abgrenzen,</li> <li>• können Sie die Funktionsweisen von Hebel-Produkten erläutern,</li> <li>• kennen Sie die wesentlichen Konstruktionsmerkmale und Funktionsweise von Hebel-Produkten sowie die Markterwartungen des Anlegers,</li> <li>• kennen Sie die Chancen und Risiken der Hebel-Produkte,</li> <li>• wissen Sie insbesondere über Warrants und Warrants mit Knock-Out detailliert Bescheid.</li> </ul>
Methodik	Selbststudium mittels interaktivem e-Learning Modul mit entdeckbaren Inhalten und Videos sowie abschliessender Lernkontrolle via Online Test.
Lernkontrolle	Ihre beiden Selbstkontrolltests bestehen aus je 15 – 20 Multiple-Choice Fragen. Sie bestehen die Tests, wenn Sie je mindestens 70% der maximalen Punktzahl erreichen.