Fintelligence

Banking & Finance: Derivate I & Strukturierte Produkte I

Bildungsangebot VSV

Titel / Thema	Derivate I & Strukturierte Produkte I
Zielgruppe	Vermögensverwalter
Lerninhalte	Das Thema Derivate erläutert wesentliche Eigenschaften und Arten von Derivaten sowie die verschiedenen Arten von Termingeschäften. Auch werden grundlegende Optionsgeschäfte aufgezeigt und die Einflussfaktoren erörtert, die den Wert von Optionen bestimmen. Das Thema Strukturierte Produkte beleuchtet den Aufbau, wesentliche Merkmale, Anlegererwartungen sowie Chancen und Risiken dieser Anlageklasse.
Lernort / Testingort	Fintelligence Online Lernplattform: https://fintelligence.fintelligence-net.com/
Lerndauer	<u>Derivate I</u> 1. Grundlagen (70 min) 2. Optionen (70 min) 3. Komponenten des Optionspreises (70 min) 4. Wert der Option (60 min) 5. Lernkontrolle (70 min) <u>Strukturierte Produkte I</u> 6. Aufbau und Merkmale (80 min) 7. Produktkategorien und Risiken (80 min) 8. Lernkontrolle (80 min)
Normlaufzeit	2 Monate
Lernziele	<u>Derivate I</u> <u>Grundlagen</u> Sie können, nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben, • den Begriff Derivate und die Eigenschaften von Derivaten erklären, • die Arten von Derivaten benennen, • Termingeschäfte nach Optionen, Futures und Forwards unterscheiden, • mögliche Basiswerte von Derivaten erläutern, • die verschiedenen Handelsmöglichkeiten von Derivaten aufzeigen, • Voraussetzungen für den Kauf und Verkauf von Derivaten auf der Kundenseite darlegen. <u>Optionen</u> Sie können, nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- den Ablauf einer Kauf- und einer Verkaufsoption erklären,
- bei Optionen die Unterschiede zwischen einer Short- und einer Long-Position erläutern,
- die vier Grundpositionen, die Käufer und Verkäufer einer Option eingehen können, unterscheiden,
- entscheiden, wann eine Option ausgeübt werden soll oder nicht,
- bei Optionen Gewinne und Verluste berechnen,
- die verschiedenen Handlungsalternativen eines Käufers oder eines Verkäufers während der Laufzeit einer Option aufzeigen.

Komponenten des Optionspreises

Sie können, nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- erläutern, von welchen Einflussfaktoren die Preisbildung von Optionen abhängt,
- entscheiden, welche Einflussfaktoren für einen Call oder Put am wichtigsten sind,
- darlegen, wie sich Veränderungen bei den Einflussfaktoren auf den Optionspreis auswirken.

Wert der Option

Durch das Studium dieses Moduls können Sie

- erklären, was unter dem fairen Wert bzw. dem theoretischen Wert einer Option zu verstehen ist,
- erläutern, wie mit der Black-Scholes-Formel der faire Optionspreis berechnet wird,
- den fairen Preis einer Option mit Hilfe einer Excel-Tabelle oder eines Optionspreisrechners ermitteln,
- die Put-Call-Parität einer Option erklären und sich die Überlegungen zur Wertbildung einer Option zunutze machen.

Strukturierte Produkte I

Aufbau und Merkmale

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- haben Sie ein grundsätzliches Verständnis für den Einsatz von Strukturierten Produkten in der Anlageberatung erhalten,
- können Sie Strukturierte Produkte verstehen, einordnen und beurteilen,
- können Sie die wesentlichen Konstruktionsmerkmale und Funktionsweisen von Strukturierten Produkten erläutern.

Produktkategorien und Risiken

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- können Sie die wichtigsten Arten von Strukturierten Produkten voneinander abgrenzen,

	• kennen Sie die Einteilung der Strukturierten Produkte gemäss der Kategorisierung des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte (SVSP), • können Sie die Chancen und Risiken der Produkttypen im Kundengespräch beschreiben.
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.