Fintelligence

Banking & Finance: Derivate II & Strukturierte Produkte II

Bildungsangebot VSV

Titel / Thema	Derivate II & Strukturierte Produkte II
Zielgruppe	Vermögensverwalter
Lerninhalte	Das Thema Derivate fokussiert die Berechnung von Optionswerten und die Interpretation wichtiger Optionskennzahlen. Ausserdem werden verschiedene Optionsstrategien aus Kundensicht und Exotische Optionen vorgestellt. 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.
Lernort / Testingort	Fintelligence Online Lernplattform: https://fintelligence.fintelligence-net.com/
Lerndauer	<u>Derivate II</u> 1. Optionskennzahlen (90 min) 2. Optionsstrategien I (70 min) 3. Optionsstrategien II (80 min) 4. Exotische Optionen (60 min) 5. Lernkontrolle (70 min) <u>Strukturierte Produkte II</u> 6. Kapitalschutz-Produkte (70 min) 7. Renditeoptimierungs-Produkte (60 min) 8. Partizipations-Produkte (70 min) 9. Hebel-Produkte (70 min) 10. Lernkontrolle (80 min)
Normlaufzeit	2 Monate
Lernziele	<u>Derivate II</u> <u>Optionskennzahlen</u> Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben, können Sie • die Unterschiede zwischen statischen und dynamischen Kennzahlen von Optionen erläutern, • 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

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- Sie können die vier grundlegenden Optionsgeschäfte (Kauf und Verkauf von Calls bzw. von Puts) entsprechend den Kundenwünschen einsetze,
- 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

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- 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

Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben,

- 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. <u>Hebel-Produkte</u> Nachdem Sie dieses Modul bearbeitet haben, • kennen Sie die fünf Arten von Hebel-Produkten gemäss der Derivative Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte (SVSP) und können sie voneinander abgrenzen, • können Sie die Funktionsweisen von Hebel-Produkten erläutern, • kennen Sie die wesentlichen Konstruktionsmerkmale und Funktionsweise von Hebel-Produkten sowie die Markterwartungen des Anlegers, • kennen Sie die Chancen und Risiken der Hebel-Produkte, • wissen Sie insbesondere über Warrants und Warrants mit Knock-Out detailliert Bescheid.
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.