

## Banking & Finance: Derivate – Optionskennzahlen, Optionsstrategien und exotische Optionen

Bildungsangebot VSV

Titel / Thema	Derivate – Optionskennzahlen, Optionsstrategien und exotische Optionen
Zielgruppe	Vermögensverwalter
Lerninhalte	Das Thema fokussiert die Berechnung von Optionswerten und die Interpretation wichtiger Optionskennzahlen. Ausserdem werden verschiedene Optionsstrategien aus Kundensicht und Exotische Optionen vorgestellt.
Lernort / Testingort	Fintelligence Online Lernplattform: <a href="https://fintelligence.fintelligence-net.com/">https://fintelligence.fintelligence-net.com/</a>
Lerndauer	<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>
Normlaufzeit	2 Monate
Lernziele	<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><li>• die wichtigsten statischen Kennzahlen von Optionen benennen und ihre Bedeutung erklären,</li><li>• die Wichtigkeit von dynamischen Kennzahlen bei der Bewertung von Optionen darlegen,</li><li>• Optionen anhand von verschiedenen dynamischen Kennzahlen beurteilen,</li><li>• die am häufigsten verwendeten dynamischen Kennzahlen anhand von Beispielen erläutern.</li></ul> <p><u>Optionsstrategien I</u></p> <ul style="list-style-type: none"><li>• Sie können die vier grundlegenden Optionsgeschäfte (Kauf und Verkauf von Calls bzw. von Puts) entsprechend den Kundenwünschen einsetzen</li><li>• Sie wissen über die unterschiedlichen Anlegermotive für Geschäftsabschlüsse in Optionen Bescheid und können sie Ihren Kunden</li></ul>

	<p>darlegen</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Optionsstrategien entsprechend der Preisentwicklung des Basiswertes und der Entwicklung der Volatilität des Basiswertes einordnen</li> <li>• Sie können wichtige Absicherungsstrategien, wie den Protective Put und den Long Call Hedge, erklären</li> <li>• Sie verstehen gängige Strategien der Renditeoptimierung, insbesondere Covered und Uncovered Call Writing sowie Naked Put Writing</li> </ul> <p><u>Optionsstrategien II</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Sie können die vier grundlegenden Optionsgeschäfte (Kauf oder Verkauf von Calls bzw. Puts) entsprechend den Kundenwünschen einsetzen</li> <li>• Sie wissen über die unterschiedlichen Anlegermotive für Geschäftsabschlüsse in Optionen Bescheid und können sie Ihren Kunden darlegen</li> <li>• Sie können Optionsstrategien entsprechend der Preisentwicklung des Basiswertes und der Entwicklung der Volatilität des Basiswertes einordnen</li> <li>• Sie können darstellen, wie gängige Renditesteigerungsstrategien umgesetzt werden und ihre Risiko-Rendite-Merkmale erläutern</li> <li>• Sie wissen über den Leverage-Begriff in Zusammenhang mit Optionen Bescheid</li> <li>• Sie verstehen den Einsatz von Optionen aus Sicht der Portfoliodiversifikation</li> </ul> <p><u>Exotische Optionen</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Sie können die Hauptmerkmale der gängigsten exotischen Optionen erklären</li> <li>• Sie sind in der Lage, die Risiko-Rendite-Merkmale von exotischen Optionen zu erläutern</li> <li>• Sie verstehen die Einsatzmöglichkeiten von exotischen Optionen und können Sie einem Kunden darlegen</li> </ul>
Methodik	Selbststudium mittels interaktivem e-Learning Modul mit entdeckbaren Inhalten und Videos sowie abschliessender Lernkontrolle via Online Test.
Lernkontrolle	Ihr Online Selbstkontrolltest besteht aus 15 – 20 Multiple-Choice Fragen. Sie bestehen den Test, wenn Sie mindestens 70% der maximalen Punktzahl erreichen.