

≡ HANDELSSTRATEGIEN UND PORTFOLIO-OPTIMIERUNG

AKTIVE STEUERUNG VON ZINS- UND CREDIT-PORTFOLIOS MIT BLOOMBERG PROFESSIONAL® SERVICE

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>In dem Intensiv-Workshop werden Sie innerhalb eines Tages praxisnah von der Simulation von Handelsstrategien bis zur Portfolio-optimierung geführt. Auf Basis eines realen Portfolios aus Staatsanleihen, Corporates, Zinsderivaten und Kreditderivaten verschaffen Sie sich einen Einblick über die Fixed-Income Risikotreiber, fundierte Kenntnisse über die Simulation von Handelsstrategien und Wissen zum Aufbau und zur Durchführung von Portfolio-Optimierungen, die auf Basis Ihrer Zins- und Credit Spread-Schätzungen maßgeschneidert umgesetzt werden.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ≡ Konstruktion, Analyse und Simulation von Zins- und Credit-Portfolios <ul style="list-style-type: none"> ● PORT (Portfoliosystem) und MARS (Multi Asset Risk System) auf Bloomberg Professional® service ● Positionseingabe, standardisierte Portfolio-Reports und Szenario-Analysen ● Horizon Return-Analysen und Stress Tests ● Aggregierte Portfolio-Kennzahlen für Bonds / Zinsswaps / Credit Default Swaps (CDS) ● Aufteilung des Portfolios nach Laufzeitbänder, Rating, Key Rate Risk, etc. ● Szenario-Analysen für Portfolios mit Bonds / Zinsswaps / CDS ● Vordefinierte historische Szenarien und Best & Worst Case ● Maßgeschneiderte Zins- und Credit-Szenarien (Interest Rate und CDS Spread Shifts) ● Simulation über Assetklassen: Zins- und Credit Spread-Änderungen simultan ● Punktueller Risikomanagement mit Interest & Credit Key Rate Risk ● Fallstudie: Hedging Zinsänderungsrisiko mit Futures ● Fallstudie: Steuerung Zinsänderungs- und Credit Spread Risiko mittels Zinsswaps und CDS ≡ Simulation von Handelsstrategien und Portfolio-Optimierung <ul style="list-style-type: none"> ● Simulation der Portfolio-Kennzahlen durch Veränderung der Gewichte ● Fallstudie: Erreichen einer Ziel-Rendite / Duration / Credit Spread ● Fallstudie: Erhöhung des Credit Risk (OAS) mittels Bonds / CDS ● Festsetzen einer Zieldefinition / Definition des Handelsuniversums (Portfolio / Benchmark / Index) ● Setzen von Grenzen / Bedingungen absolut und relativ zur Benchmark ● Festlegen der Wertpapier-Eigenschaften ● Festlegen von Long / Short-Positionen ● Settings für die Optimierung wie Transaktionskosten, etc. ● Fallstudien: Minimierung des Portfolio Total Risk / Turnover, etc. ● Effizienzkurve (Efficient Frontier) und Backtesting ● Optimierungs-Resultate ● Fallstudie: Optimierung mit Ertragsschätzungen 	<p>KATEGORIE Risikomanagement</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER R_14</p>