

PRÜFUNG DER MARKTGERECHTIGKEIT

BANDBREITEN-PRÜFUNG MIT BLOOMBERG PROFESSIONAL® SERVICE

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Sie erfahren in dem Seminar, wie Sie praxisnah die Marktgerechtigkeit von Finanzprodukten nach den Mindestanforderungen an das Risikomanagement (MaRisk) prüfen können: mit der preisbasierten, renditebasierten Bewertung, der Bewertung über Spread/ Barwert und implizite Volatilität. Sie lernen, wie Sie Verfahren zur Festlegung von Bandbreiten anwenden: die Zeitreihenanalyse und die Geld-Brief-Spannen in der Marktbeobachtung. Speziell diskutieren wir Bandbreiten und die Parameter zur Festlegung für die wichtigsten Produkte aus der Praxis. Die Implikationen aus der Finanzkrise für die Kontrolle runden das Thema ab.</p>	<ul style="list-style-type: none"> ☰ MaRisk, Methoden der Kontrolle und Festlegung von Bandbreiten <ul style="list-style-type: none"> ● Rahmenbedingungen der Marktgerechtigkeitskontrolle ● Überprüfung der Marktgerechtigkeit nach MaRisk ● Aktuelle Prüfungsfeststellungen, Beschaffung der Marktdaten, Arbeitsanweisung ● Preis-basierte und Rendite-basierte Kontrolle ● Spread-basierte Kontrolle ● Barwert-basierte Kontrolle ● Kontrolle über implizite Volatilitäten ● Kontrolle im 4-Augen-Prinzip ● Festlegung der Bandbreiten ● Zeitreihenanalyse ☰ Kontrolle von Kasse-Instrumenten <ul style="list-style-type: none"> ● Geldmarktzinssätze (Money / Deposit Rates) ● Staatsanleihen (Government Bonds) ● Jumbo Pfandbriefe / Covered Bonds / Pfandbriefe / SSD / IHS / Corporate Bonds ● Floating Rate Notes ● Investmentfonds / Exchange Traded Funds / Aktien ● Devisenkassa- und Termingeschäfte ● Pensionsgeschäfte (Repo und Wertpapierleihe) ☰ Kontrolle von Zins- und Kreditderivaten und strukturierten Zinsprodukten <ul style="list-style-type: none"> ● Forward Rate Agreements (FRAs) ● Zinsswaps (IRS) und komplexere Swapstrukturen ● Caps & Floors / Receiver & Payer Swaptions ● OTC-Optionen auf Anleihen ● OTC-Optionen auf Währungen (Devisenoptionen) ● Credit Default Swap ● Capped Floating Rate Note 	<p>KATEGORIE Aufsichtsrecht</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER A_16</p>