

prozess & controlling

[K09-Co2] Investment- und Risikocontrolling n. Investmentgesetz und DerivateV

Seminarinhalte

Dieses 2-tägige Intensivseminar festigt und vertieft die Kenntnisse zu den Anlagegrenzen des Investmentgesetzes und der Derivateverordnung. Die Teilnehmer lernen die aus dem Gesetz resultierenden Anlagebeschränkungen bis auf %-Ebene kennen und erarbeiten sich die Überleitung in anwendbare Formeln. Die Teilnehmer werden für unterschiedliche Interpretationen des Gesetzes sensibilisiert. Das Seminar richtet sich an Mitarbeiter, die im Bereich Anlagegrenzprüfung tätig sind.

Anlagegrenzen für das Fondsvermögen

- richtlinienkonforme Fonds
 - Überblick über zulässige Assetklassen und deren Grenzen
- Anlagegrenzen spezieller Fondsarten
 - Aktien-Indexfonds, Aktien-Laufzeitfonds
 - Offene Immobilienfonds
 - Geldmarktfonds, Altersvorsorgefonds
 - Dachfonds, Hedgefonds
 - gemischte Wertpapier - & Grundstücks-Sondervermögen

Regeln im InvG

- Überblick über zulässige Assetklassen und deren Grenzen
- Handelsplätze zulässiger Assetklassen, nicht börsennotierte Werte
- Anlagegrenzen im Bezug auf
 - Wertpapiere, Geldmarktinstrumente
 - emittentenbezogene Anlagegrenzen
 - Bankguthaben, Investmentanteile
 - Derivategrenzen und Berechnung
 - Kreditaufnahme, Leerverkäufe
 - Wertpapierdarlehen, Pensionsgeschäfte
 - Ausstellergrenzen, Stimmrechte
- Erweiterte Anlagegrenzen
 - Wertpapierindex-Sondervermögen
 - Hedgefonds, Dachhedgefonds
 - Sonst. Sondervermögen und Infrastruktursondervermögen

Einführung Regelsystematik

- Regelgruppen (Gesetz allgemein, speziell, Vertrag, Kunden-/Managementvorgaben)
- Regelstruktur, Regelteile, Regellogik
- Organisation von Regeln
 - Welche Regel(gruppe) für welche/n Fonds(gruppe)? Welche Assetklassen kommen zum Einsatz?
 - Welche Regel braucht welche Datenaggregate, Kompromisse?
- Arten von Regeln

Risikocontrolling InvG/Derivateverordnung

- Derivateverordnung: Prinzipien, Struktur
- Risikomanagement und -steuerung
- Einfacher Ansatz
 - Marktrisiko, Anrechnungsbetrag
 - Kreditrisiko Emittent
 - Kreditrisiko OTC Kontrahent
- Qualifizierter Ansatz
 - Risikomodell, Value at Risk
 - Marktrisiko/Vergleichsvermögen
 - Organisation, Behandlung Risiken
- Stresstests
- Umgang mit strukturierten u. verbrieften Derivateprodukte

Meldewesen

→ Quiz [rund um das Investmentgesetz zur Vertiefung des Erlernten]

Zielgruppe

- Mitarbeiter im Fondscontrolling

Vorkenntnisse

Grundkenntnisse Fonds
Wissen Wertpapiere
Wissen Derivate

Seminardaten:

Dauer: 2 Tage
Preis: EUR 1.250 (+ Mwst.)
Teilnehmer: maximal 12
03.-04. März 2009
28.-29. Oktober 2009

Termine: