

Strukturierte Produkte im Portfoliokontext: Mehrwert oder nur Märwert?

Der Mehrwert Strukturierter Produkte im Portfoliokontext wurde im Rahmen einer umfassenden Analyse untersucht. Dabei ging es darum, die Auswirkungen des Einsatzes von Strukturierten Produkten quantitativ nachzuweisen. Grundlage bildet eine grosse Stichprobe von realen Produkten, die zwischen 2011 und 2017 an der Schweizer Börse SIX Exchange emittiert und zurückbezahlt wurden. Die Studie beruht auf der Maximierung des erwarteten Nutzens für das gesamte Portfolio unter Berücksichtigung konkurrenzierender Anlagemöglichkeiten und über eine Reihe relevanter Marktszenarien hinweg.

Die durchgeführte Auswertung zeigt, dass Strukturierte Produkte in verschiedenen Marktszenarien eine rationale Anlagealternative darstellen. Und auch, wo dies nicht der Fall ist. Die Ergebnisse liefern quantitative Beweise, inwiefern Strukturierte Produkte die Gesamtleistung eines Anlageportfolios verbessern.

Claudio Topatigh, Leiter Kompetenzzentrum Strukturierte Produkte



Claudio Topatigh ist Leiter des Kompetenzzentrums für Strukturierte Produkte bei der Luzerner Kantonalbank, zu der er im August 2017 stiess. Bei der LUKB trägt er die Verantwortung für das Emissions- und Handelsgeschäft des neu geschaffenen Bereichs der Strukturierten Produkte. Zuvor war er mehrere Jahre für die Raiffeisen-Gruppe und für die Zürcher Kantonalbank im Geschäft mit strukturierten Anlagelösungen tätig. Der studierte Betriebswirt und Finanzanalyst ist seit 2010 im Besitz des MAS in Finance der UZH/ETH.

Kontakt details

Claudio Topatigh
+41 44 206 99 55
strukturierteprodukte@lukb.ch
strukturierteprodukte.lukb.ch