

[SWP] Swaps im Fonds

Seminarinhalte

Das Seminar startet mit einer Auffrischung der Abgrenzung zwischen börsengehandelten und OTC-Derivaten. Fokus des Seminars sind Swaps im Fonds: Die Teilnehmer erhalten einen Überblick über die einzelnen Swap-Arten und deren Motivation. Eine Darstellung der Zahlungsströme und der Berücksichtigung der Swaps in der Fondspreisermittlung runden das Seminar ab.

Einführung OTC-Derivate

- Abgrenzung Börsenhandel und OTC-Handel
- EMIR
 - Regulierung des Derivatemarktes
 - Clearing, CCP

Swaps: Von was sprechen wir?

- Definition
- Handel von Swaps
- Auflösung von Swaps
 - Gegengeschäft
 - Barausgleich
 - Assignment
- Übersicht Swaps

Swaps im Detail

- IRS / Zinsswaps
 - Payer/Receiver-Swap, Motivation
 - Vertragsbestandteile
 - Upfront-Fee, Ausgleichszahlungen, Bewertungsprinzip
 - Darstellung in der Fondsbuchhaltung
- Währungsswaps
 - Unterschied zum Zinsswap
 - Zahlungsströme
- Total-Return-Swaps
 - TRS-Zahler, TRS-Empfänger
 - TRS-/Risikoprämie
 - Reset-Zahlung / Swap-Reset
- Credit Default Swap
 - Funktionsweise
 - Prämie, Kreditereignisse
 - Baskets, iTraxx
 - Zahlungsflüsse
- Swaption
 - Payerswaption, Receiverswaption

Zielgruppe

- Mitarbeiter im Investment- und Risikocontrolling
- Mitarbeiter in der Fondsbuchhaltung

Vorkenntnisse: Grundkenntnisse Investmentfonds

Seminardaten: Dauer: 3 Stunden
Preis: EUR 550 (+MwSt.)
Max. 10 Personen

Termin: 23.2.2021 14-17 Uhr (Online)
7.9.2021 14-17 Uhr (Online)