

Nutzung von Swaptions zur Absicherung impliziter Kundenoptionen

Seminarnummer	20.09.2028.01
Termin	Montag, den 14.09.2020
- Zeit	08:30 Uhr bis 16:30 Uhr
- Ort	Raum 2, Akademie der Sparkassen-Finanzgruppe Saar
- Referent/in	Simon Feyen, msgGillardon AG
Zielgruppen	Erfahrene Mitarbeiter/-innen aus den Bereichen Risikocontrolling und Treasury
Zielsetzung	Durch das geänderte Kundenverhalten im aktuellen Niedrigzinsumfeld steigen die Anforderungen an die Steuerung der Zinsänderungsrisiken einer Sparkasse. In diesem Expertenworkshop werden daher die Einsatzmöglichkeiten von Swaptions in der Gesamtbanksteuerung, insbesondere zur Absicherung von impliziten Kundenoptionen, vorgestellt. Auch weitere Einsatzmöglichkeiten werden aufgezeigt. Neben der technischen Abbildung in den Standardsystemen wird auch ein standardisiertes Vorgehen zur MaRisk-konformen Einführung als neues Produkt (NPP) aufgezeigt. Ebenso werden aktuelle Anforderungen, die sich aus der EMIR-Verordnung ergeben, behandelt. Darüber hinaus erfolgt eine Abgrenzung von Swaptions zu anderen derivativen Finanzinstrumenten in der Gesamtbanksteuerung. Die Teilnehmer/-innen profitieren im Workshop vom Austausch mit Experten und sind über die aktuellen Entwicklungen im Bereich des Einsatzes von Derivaten in der Gesamtbanksteuerung und der Behandlung von Risiken aus impliziten Kundenoptionen informiert.
Inhalte	• Aktuelle Einflussfaktoren auf das Zinsänderungsrisiko einer Sparkasse ◦ Geänderte Laufzeitenstruktur in den Standardprodukten ◦ Swaptions als mögliches Absicherungsinstrument • Technische Abbildung von Swaptions • Einordnung von Swaptions in den aktuellen aufsichtsrechtlichen Kontext (u. a. EMIR) • MaRisk-konforme Produkteinführung (NPP) • Ausblick (u.a. Auswirkung der veränderten Rahmenbedingungen)
Voraussetzungen	Kenntnisse zu impliziten Kundenoptionen und im Bereich derivativer Finanzinstrumenten, sowie zu SimCorp Dimension
Zuständig	
- Organisation	Backes, Timo timo.backes@svsaar.de
- Inhalt	Stephan, Lisa-Marie lisa-marie.stephan@svsaar.de
Meldeschluss	Freitag, den 07.08.2020