

I. Definicja instrumentów pochodnych na podstawie bazowych transakcji skarbowych Fx Spot i transakcji depozytowych

- Fx Spot – charakterystyka kwotowa rynkowych
- Depozyty – kwotowania rynkowe
- Definicja instrumentów pochodnych

II. FX Forward i FX Swap

- Punkty Swap'owe
- Różnica między Fx Forward a Fx Swap
- Przykłady wyliczania kursów terminowych
- Wycena rynkowa transakcji Fx Forward
- Ćwiczenia

III. Opcje Walutowe

- Definicja Opcji, ich rodzaje i klasyfikacja
- Podstawowe różnice między Opcjami a transakcjami Fx Forward
- Złożenia opcji
- Najbardziej znane strategie opcyjnie na rynku polskim
- Przykłady kwotowań
- Ćwiczenia

IV. Swap procentowy – IRS

- Definicja i charakterystyka transakcji zamiany stopy procentowej
- Przykłady kwotowań
- Różne rodzaje transakcji IRS
- Ćwiczenia

V. FRA

- Ogólna charakterystyka
- Przykład rozliczenia transakcji
- Ćwiczenia

Profil

Szkolenie jest przeznaczone przede wszystkim dla:

- Pracowników Back i Middle Office
Departamentów Skarbu
- Pracowników Audytu Wewnętrznego
- Pracowników Controllingu

Poziom

Osoby posiadające podstawową wiedzę z zakresu instrumentów finansowych

Metodyka

Seminarium – prezentacja. Uczestnicy będą proszeni o wykonywanie praktycznych ćwiczeń, ilustrujących omawiane zagadnienia, przy użyciu arkusza kalkulacyjnego..