SIJOITUSAKATEMIA



Swap-sopimusten yleiset arvostusmenetelmät ja riskilaskenta
Projektio- ja diskonttokäyrien rakentaminen, sekä numeeriset kalibrointimenetelmät
Swap-sopimusten käyttö erilaisista näkökulmista (ALM, Funding ja Portfolio Management)
Erilaisten swap-sopimusten hinnoittelu: Fixed-to-Float Swap, Tenor Basis Swap,
Cross-currency Basis Swap ja Fix-to-Float Cross-currency Swap

SWAP-SOPIMUKSET

29.1.2027

Verkkokoulutus

www.sijoitusakatemia.fi | ilmoittautuminen@sijoitusakatemia.fi | 045 317 6363 ja 045 881 2442

SIJOITUSAKATEMIA

SWAP-SOPIMUKSET

29.1.2027

Verkkokoulutus

Koulutuksen tavoite

Kurssipäivän aikana tutustumme monipuolisesti markkinoilla käytettäviin erilaisiin koronvaihtosopimuksiin useiden käytännönläheisten esimerkkien ja workshop-tehtävien muodossa. Kurssin päättyessä sinulla on valmiudet ymmärtää erilaisten koronvaihtosopimusten käyttötarkoituksia esim. ALM-, Funding- ja Portfolio Management-näkökulmasta. Lisäksi saat sekä teoreettiset että käytännön valmiudet kyseisten tuotteiden hinnoitteluun ja riskilaskentaan. Osallistumalla kurssille saat mukaasi rakennetut esimerkit erilaisten koronvaihtosopimusten arvostus- ja riskilaskentaa varten sekä materiaalia jatkossa tapahtuvaa itsenäistä lisäopiskelua ja harjoittelua varten.

Kohderyhmä

Koulutus soveltuu rahoitusalalla jo työskenteleville henkilöille, joiden työnkuvaan liittyy olennaisesti koronvaihtosopimusten käyttöä, esim. arvostus- ja/tai riskilaskentaa. Osallistujan odotetaan omaavan kohtuulliset Microsoft Excel -käyttötaidot, sekä finanssimatemaattisten peruskäsitteiden ymmärryksen.

Hinta

Koulutuksen hinta on 875 euroa, johon lisätään arvonlisävero. Hintaan sisältyy opetus, luentomateriaalit ja harjoitukset. Osallistumismaksun laskutamme koulutuksen jälkeen.

Kysy myös ryhmätarjousta osoitteesta tiedustelut@sijoitusakatemia.fi

Koulutuksen järjestäjä

Sijoitusakatemia Oy on Suomen johtava rahoitus- ja sijoitusalan ammatillista täydennyskoulutusta järjestävä organisaatio. Koulutusten keskeinen kohderyhmä ovat rahoitus- ja sijoitusalan ammattilaiset – johdosta operatiiviseen henkilöstöön. Koulutuksissa käsitellään käytännönläheisesti alan ammattilaisten keskeisiä osaamisalueita kuten juridiikkaa ja sääntelyä, erilaisia rahoitus- ja sijoitusinstrumentteja, tuoton ja riskin mittaamista, Excelin hyödyntämistä rahoitus- ja sijoitustoiminnassa sekä muita alan ajankohtaisaiheita.

Sijoitusakatemia järjestää sekä julkisia että yrityksille räätälöityjä kursseja ja seminaareja. Kursseilla pääpaino on käytännön harjoitustöissä, jotka tehdään tietokoneilla. Seminaareihin on koottu puhujiksi käsiteltävän aihealueen johtavia asiantuntijoita. Koulutukset pidetään Helsingin keskustassa. Sijoitusakatemian henkilökunnalla on pitkä kokemus hyvien koulutustilaisuuksien suunnittelusta ja toteuttamisesta.

Sijoitusakatemia Oy kuuluu Sijoitustutkimus -ryhmään, joka on Suomen johtava sijoitustoiminnan asiantuntijapalveluiden tarjoaja. Olemme varainhoitajista ja sijoituspalvelujen tarjoajista riippumaton toimija, joka ei suosittele eikä promovoi sijoitustuotteita. Palvelemme ihmisiä ja organisaatioita sijoitustoiminnan suunnittelun ja seurannan, varainhoidon kilpailutuksen ja finanssialan koulutuksen alueilla. Sijoitustutkimus -ryhmän kotisivut löytyvät osoitteesta www.sijoitustutkimus.fi.

Päivän ohjelma

29.1.2027

Swap-sopimusten yleiset arvostusmenetelmät

a. Yksikäyrähinnoittelu

- Geneerisen koronvaihtosopimuksen arvostaminen ja korkoriskin laskentamenetelmä
- Finanssikriisin vaikutukset korkotuotteiden hinnoitteluun, sekä diskontto- ja projektiokäyrien rakentamiseen

b. Kaksoiskäyrähinnoittelu

- Projektio- ja diskonttokäyrän rakentaminen
- Arvostuskäyrien bootstrapping ja numeeriset kalibrointimenetelmät
- Rakennamme kaikki kurssipäivän aikana jatkossa tarvittavat diskontto- ja projektiokäyrät

Swap-sopimukset

- Jokaisen swap-sopimustyypin osalta käymme läpi seuraavat asiat:
  1) Luento: tuotteen yleiset ominaisuudet, payoff-profiili ja arvostusmenetelmät
  2) Workshop: tunnistamme ja käymme läpi erilaisia motiiveja ko. swap-sopimuksen käytölle (esim. ALM, Funding tai Portfolio Management)
  3) Excel-workshop: implementoimme swap-sopimuksen hinnoittelun ja riskilaskennan

Kurssipäivän aikana käymme läpi seuraavat swap-sopimukset:

1) Fixed-to-Float Swap

- Vaihdetaan yhden valuutan sisällä kiinteä korko vaihtuvaan viitekorkoon
- Esim. EUR Fixed vs. EUR 6M Euribor

2) Tenor Basis Swap (Cross-market Swap)

- Vaihdetaan yhden valuutan sisällä vaihtuva viitekorko toiseen vaihtuvaan viitekorkoon
- Esim. 3M EUR Euribor vs. 6M EUR Euribor

3) Cross-currency Basis Swap

- Vaihdetaan yhden valuutan vaihtuva viitekorko toisen valuutan vaihtuvaan viitekorkoon
- Esim. 3M EUR Euribor vs. 3M SEK Stibor

4) Fix-to-Float Cross-currency Swap

- Vaihdetaan yhden valuutan kiinteä korko toisen valuutan vaihtuvaan viitekorkoon
- Esim. USD Fixed vs. 6M EUR Euribor

AIKATAULU

8.50	Ilmoittautuminen ja yhteyskokeilut
9.00	Koulutuksen avaus
12.00	Lounas (50 min.)
16.00	Päivän päätös

Aamu- ja iltapäivällä n. 15min. kahvitauot

Päivän kouluttaja

Kurssin kouluttaja **Mikael Katajamäki** (KTM, CQF) työskentelee tällä hetkellä investointipankissa markkina- ja likviditeettiriskin hallintayksikössä nimikkeellä Senior Risk Analyst.

Ilmoittautuminen

Sijoitusakatemia Oy
Vuorikatu 14 A
00100 Helsinki
www.sijoitusakatemia.fi
ilmoittautuminen@sijoitusakatemia.fi
Puh. 045 317 6363, 045 881 2442

Lisätiedot: tiedustelut@sijoitusakatemia.fi tai puh. 045 317 6363

Peruutus- ja muutosehdot
Pyydämme ilmoittamaan peruutukset sähköpostitse. Ilmoittautumisen voi peruuttaa maksutta viimeistään kaksi viikkoa ennen tilaisuutta. Tämän jälkeen laskutetaan peruutuskuluina 40% + alv tapahtuman hinnasta. Jos varattu koulutuspaikka jätetään käyttämättä, eikä asiasta ilmoiteta, osallistujalta laskutetaan tapahtuman normaali hinta. Esteen ilmetessä seminaaripaikan voi luovuttaa kollegalle. Tästä pyydetään ilmoittamaan Sijoitusakatemiaan.

