

Хеджирование валютных рисков с использованием биржевых инструментов



2 Группы управляемых рисков

Валютные риски

- > Рубль
- > Доллар
- > Евро
- > Юань
- > ...

Риски процентных ставок и волатильности

Ценовые риски

- > Нефть и производные
- > Электроэнергия
- > Металлы
- > Товары
- > Акции

- > Возможность предоставления котировки в биржевом стакане по всему классу торгуемых биржевых фьючерсов и опционов по запросу клиента, на практически неограниченный объем.
- > Преимущество хеджа с использованием биржевых инструментов— отсутствие риска неисполнения контрагентом своих обязательств.
- > Исполнение биржевых фьючерсов и опционов гарантирует биржа.

3 Порядок взаимодействия по хеджированию

Встреча

- Обсуждение бизнеса контрагента. Определение наиболее существенных групп рисков. Уточнение временных горизонтов.

Подготовка предложения

- Подбор инструментария. Определение стоимости хеджирования по группам рисков. Подготовка графика движения ДС. Лимиты и стоимость фондирования.

Реализация

- Сбор документов. Открытие необходимых счетов. Реализация плана. Мониторинг.

4 Преимущества

Гибкое ценообразование

- Установление кредитных лимитов на контрагента
- Возможности начисления вознаграждения на остатки
- Использование широкого класса активов в качестве обеспечения
- Низкие биржевые издержки
- Комплексный подход к установлению комиссий и вознаграждения

Большие возможности

- Доступность зарубежных рынков (LSE, CME Group, EBS, LME, LIFFE, EUREX, ICE)
- Возможность использования OTC вкупе с биржевыми инструментами
- Полная интеграция с десками IB (Money-market, REPO, FI, Equity, Derivatives, Structured Products)
- Единый маржинальный счет для всех типов биржевых операций
- Настройка индивидуального риск-профиля
- Наличие банка в структуре группы

Надежность и прозрачность бизнеса

- ISDA, GMRA,
- Юрисдикция UK, регуляция FSA
- Юрисдикция Cyprus
- Юрисдикция РФ
- Наличие собственной экспертизы
- Наличие международных рейтингов
- Высокий рейтинг по национальной шкале



Спасибо за внимание!
