

Auslandszahlungen

Kurs- und Zinssatzsicherung

www.raiffeisen.at

Raiffeisen. Meine Bank



Auslandszahlungen

Kurs- und Zinssatzsicherung

1	Auslandszahlungen	Seite 5
1.1	Einleitung	
1.2	EU-BZV – Europäischer Binnenzahlungsverkehr	
1.3	IBAN (International Bank Account Number)	
1.4	UN/EDIFACT (Electronic Data Interchange for Administration, Commerce & Transport)	
1.5	Veränderungen der Zahlungsverkehrs- und Clearingsysteme	
2	Zahlungsverkehrsoptimierung zwischen Kunden und Bank	Seite 9
2.1	Electronic Banking	
2.1.1	ELBA-business	
2.1.2	MultiCash	
2.2	Cash Management	
2.2.1	Regionales Cash Management	
2.2.2	Cash Pooling	
3	Zahlungen in das Ausland	Seite 16
3.1	Zahlungen in das Ausland durch SWIFT	
3.2	Zahlungen in das Ausland durch Versendung von Schecks	
3.3	Raiffeisen Euro Transfer	
3.4	Bargeldauszahlungsservice	
4	Zahlungen aus dem Ausland	Seite 21
4.1	Zahlungseingänge in Form von Schecks	
4.2	Fremdwährungskonto	
4.2.1	Exporterlössammelkonto	
4.2.2	Collection & Disbursement Account/Raiffeisen Europakonto	
5	Auslandswechsel – Inkasso	Seite 24
5.1	Grundsätzliches	
5.2	Wechselinkasso – Wechsel zahlbar im Ausland	
5.3	Wechselinkasso – Wechsel zahlbar im Inland	
6	Currency Codes (Währungsabkürzungen)	Seite 27

7 Kurssicherung

Seite 32

- 7.1 Warum Kurssicherung?
- 7.1.1 Aktives Kursrisikomanagement
- 7.2 Kursbildung
 - 7.2.1 Limite im Devisenhandel
- 7.3 Devisenkassageschäft
- 7.4 Devisentermingeschäft
- 7.5 Devisenswap
- 7.6 Devisenfutures
- 7.7 Devisenoptionen
 - 7.7.1 Definition
 - 7.7.2 Grundstrategien mit Währungsoptionen
 - 7.7.2.1 Kauf eines Calls (Long Call)
 - 7.7.2.2 Verkauf eines Calls (Short Call)
 - 7.7.2.3 Kauf eines Puts (Long Put)
 - 7.7.2.4 Verkauf eines Puts
 - 7.7.2.5 Zusammenfassung
- 7.8 Kurssicherungsstrategie – Anwendungsbeispiele
 - 7.8.1 Absicherung einer Fremdwährungsverbindlichkeit
 - 7.8.2 Absicherung einer Fremdwährungsforderung

8 Zinssatzsicherung

Seite 50

- 8.1 Forward Rate Agreement (FRA)
- 8.2 Interest Rate Swap (IRS)
 - 8.2.1 Ausgestaltung
 - 8.2.2 Beendigung eines Swaps
 - 8.2.3 Verwendung von Interest Rate Swaps
 - 8.2.4 Vorteile von Swaps
 - 8.2.5 Risiken von Swaps
- 8.3 Cross Currency Interest Rate Swap
 - 8.3.1 Ausgestaltung
 - 8.3.2 Formen von Cross Currency Interest Rate Swaps
 - 8.3.3 Marktteilnehmer
 - 8.3.4 Verwendung von Cross Currency Interest Rate Swaps
 - 8.3.5 Risiken bei Currency Swaps
- 8.4 Zinsoptionen
 - 8.4.1 Cap
 - 8.4.2 Floor
 - 8.4.3 Collar

9 Begriffserklärungen

Seite 63