

Derivaten voor analisten: focus op modellen en risicobeheer

DOELSTELLINGEN

Je hebt als analist of risk manager nood aan kennis over modellen, producten en de bijhorende risico's? Deze opleiding biedt diepgaande kennis over de waarderingsmodellen en risicobeheer. We bespreken alle aspecten van forward en futures prijzen, no arbitrage en risk neutral concepten, Black Scholes Merton , Greeks en Monte Carlo simulaties, exotische opties en rentederivaten. Er wordt hierbij extra aandacht besteed aan de waardering, de wiskundige berekening, de risico's en de concrete toepassingen van deze instrumenten.

SAMENVATTING

Categorie:

- Private banking & asset management

Niveau:

Expert

Type opleiding:

Blended learning

Prijs:

In kader van paritair initiatief, worden de paritaire prijsrichtlijnen toegepast.

Punten/uren:

- Bank: **6**

Attestering:

- 600.013

DOELGROEP

De opleiding kan gevolgd worden door verschillende doelgroepen, namelijk door directieleden, kaderleden en bedienden:

- met een functie risk manager, analist, quant of product management;
- die verantwoordelijk zijn portefeuillebeheer;
- uit de overheid en de controleorganen;
- met een functie in Compliance;
- met een functie in de marktenzaal;
- die lid zijn van de Raad van Bestuur, deel uitmaken van de directie van de operationele organen of medewerker zijn van een organisme voor de financiering van pensioenen (OFP);
- uit boekhoudkundige, juridische, fiscale, operationele en administratieve departementen.

VEREISTE VOORKENNIS

Expert level: licht specifiek een bepaald onderwerp grondig toe. Om dit niveau van opleiding te kunnen volgen, moet u over voldoende voorkennis beschikken (expertise).

PROGRAMMA

Inhoud

Deze opleiding bestaat uit een e-learning en een klassikale sessie. De e-learning moet je voor de deelname aan de klassikale sessie doorlopen.

E-learning

- No arbitrage
- Berekenen van forward prijzen
- Onderscheid tussen forward prijs en de waarde van een forward
- Het basisrisico

Klassikale sessie

In deze klassikale sessie staan praktijkvoorbeelden en oefeningen centraal. Wiskundige concepten worden duidelijk uitgelegd met het accent op begrijpen. Bijkomende documentatie is voorzien voor meer diepgaande uitleg. We onderzoeken samen wat de kenmerken zijn van bepaalde derivaten, hoe risicovol ze zijn en hoe ze voor de klant potentieel interessant kunnen zijn.

Volgende onderwerpen worden behandeld:

- Black Scholes Merton & Monte Carlo
 - Stochastische processen

- Partiële differentiaalvergelijking van Black Scholes Merton
- Waarderen van Europese opties met het BSM model
- Prijs berekenen van een optie met Monte Carlo simulatie
- Exotische opties
 - Rangschikken van de belangrijkste soorten exotische opties
 - Exotische opties versus vanilla opties
 - Onderscheid tussen forward start, cliquet, chooser, barrier, lookback, Asian, exchange en binary opties
 - Het verbod op commercialisering van binaire opties in België
- Rentederivaten
 - Waarderen van opties op obligaties
 - Waarderen van opties op rentevoeten en op renteswaps
 - Afdekking met rentederivaten
 - Identificeren van synthetische rentederivaten

Praktische informatie

Duurtijd: 1 dag opleiding + 1 e-learning (doorlooptijd circa 1u)

Uren van de opleidingsdag: 9u-17u (6 lessen per dag)

Locatie: Deze opleiding zal online gegeven worden.

METHODOLOGIE

Type opleiding: Online, blended learning

Tijdens onze **hybride opleidingen** bieden we een combinatie aan interactieve zelfstudie en een praktijkgerichte sessie in groep. De zelfstudie bestaat uit een e-learningmodule met theorie, video en quizvragen. Tijdens het groepsmoment ligt de focus op het inoefenen van de materie en het werken met cases uit de praktijk.

Lesmateriaal:

- E-learning
- Keynote slides
- Multimedia presentatie (slides, annotaties, video, internet)

De opleiding betreft de technische kennis m.b.t. de financiële producten in bank- en beleggingsdiensten overeenkomstig art. 7, §1, 1°, b en c van het K.B. van 1 juli 2006.