Derivaten voor beheerders: focus op rente-instrumenten

DOELSTELLINGEN

Deze opleiding bestaat uit een E-learning en een live webinar. De E-learning moet je voor de deelname aan het live webinar doorlopen.

Je komt als portefeuillebeheerder, relatiegelastigde of Compliance Officer regelmatig in aanraking met renterisico en renteafdekking? Deze opleiding gaat dieper in op de rentederivaten. Je raakt vertrouwd met alle aspecten van de rentemarkten, inclusief de basisbegrippen van actuariële berekeningen. We leren je de prijsstelling, de risico's en de concrete toepassingen van rente-instrumenten begrijpen.

SAMENVATTING

Categorie:

- Private banking & asset management

Niveau:

Expert

Type opleiding:

Live webinar

Prijs:

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

Bijscholingsuren:

- Bank: **7u** sectorspecifiek

DOELGROEP

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

- die verantwoordelijk zijn voor financiële adviesverlening en/of dienstverlening aan ondernemingen of aan klanten: portefeuillebeheerders, relatiegelastigden;
- 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 opleiding: deze opleiding vereist een grondige kennis van het onderwerp.

Voorbereiding: Deze opleiding vereist een grondige voorbereiding op het interactief moment aan de hand van een E-learning.

PROGRAMMA

INHOUD

In de live webinar sessie staan praktijkvoorbeelden en oefeningen centraal. Wiskunde is toegankelijk en wordt duidelijk geïllustreerd aan de hand van sprekende voorbeelden. We onderzoeken samen wat de kenmerken zijn van bepaalde derivaten, hoe risicovol ze zijn en hoe ze voor de klant potentieel interessant kunnen zijn.

E-learning *(duurtijd 1 uur)*

Doorloop de E-learning alvorens deel te nemen aan de klassikale opleiding. Het interactief moment is bedoeld ter ondersteuning van de kennis opgedaan in de E-learning. Denk jij al de nodige voorkennis te hebben? Toets je kennis af aan de hand van een preassessment op de eerste pagina van de E-learning.

- Preassessment
- De rentemarkt
- Forward rentevoeten en wisselkoersen
- De werking van Forward Rate Agreements
- Duration en convexiteit van obligaties

Live webinar sessie *(duurtijd 6 lesuren)*

- Pop quiz: Hoeveel heb je onthouden van de E-learning?
- Rentefutures
  - De prijsstelling van rente instrumenten
  - De kenmerken van de Cheapest To Deliver obligatie
  - Obligatiefutures om de duration van een portefeuille af te dekken
  - Verbanden leggen tussen een Forward Rate Agreement en een Short Term Interest Rate futures
- Renteswaps en valutaswaps
  - Het belang van swapcontracten
  - Een Interest Rate Swap waarderen
  - Een Currency Swap waarderen
  - Het kredietrisico van swapcontracten identificeren
- Kredietderivaten
  - Het kredietrisico
  - Een Credit Default Swap waarderen
  - Het onderscheid maken tussen Asset Swap, Credit Default Swap en Total Return Swap
  - Het waterfall principe bij effectisering

PRAKTISCHE INFORMATIE

- **Duurtijd:** E-learning (duurtijd 1 uur) en 1 lesdag (6 lesuren)
- **Uren:** 09:00 tot 17:00
- Deze opleiding zal online plaatsvinden.
- **Extra informatie:** Hoe start je de webinar vlot op? Je ontvangt een login en een wachtwoord per e-mail om toegang te krijgen tot ons platform. In het platform vind je een link. Door op de geplande datum te klikken start de webinar via Webex.
  Om bijscholingsuren te behalen is het belangrijk om met je eigen naam in te loggen, de volledige trainingsdag te volgen en de door de trainer voorgestelde vragen te beantwoorden. Volg de opleiding niet met meerdere personen via eenzelfde pc.
- **Voorbereiding:** doorloop de E-learning alvorens deel te nemen aan het live webinar. Het interactief moment is bedoeld ter ondersteuning van de kennis opgedaan in de E-learning.
  Denk jij al de nodige voorkennis te hebben? Toets je kennis af aan de hand van een preassessment op de eerste pagina van de E-learning.

METHODOLOGIE

Een **'Live webinar'** volg je digitaal in groep. Het is 'learning-apart-together'. Op een afgesproken tijdstip loggen docent en deelnemers in op een videoconference-tool, elk van op de eigen locatie en met de eigen computer. Via camera, microfoon en chatfunctie van deze tool is er mogelijkheid tot interactie en feedback, zowel van de deelnemers naar de docent toe als omgekeerd. Het lesmateriaal bestaat als basis uit een presentatie via het MyFA leerplatform, aangevuld met diversen zoals (digitale syllabus, presentatie, audiovisuele fragmenten, …).

Type opleiding: Hybride

Tijdens onze **hybride opleidingen** combineren we zelfstudie (E-learning) met een interactieve component (klassikale opleiding of live webinar). Tijdens de interactieve sessie ligt de focus op het inoefenen van de materie en het werken met cases uit de praktijk.

Opleidingsmateriaal:

- 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.