Derivaten voor analisten: focus op modellen en risicobeheer

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 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:

- Risk, finance & treasury

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:

- 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 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 groepssessie staan praktijkvoorbeelden en oefeningen centraal. Wiskundige concepten worden duidelijk uitgelegd met het accent op begrijpen. Bikomende 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.

E-learning *(duurtijd 1 uur)*

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.

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

Live webinar

- Pop quiz: Hoeveel heb je onthouden van de E-learning?
- 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:** E-learning (1 uur) en 1 lesdag (6 lesuren)
- **Uren:** 09:00 tot 17:00
- **Plaats**: 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.

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.