

מודול FV404: מידול נגזרים באמצעות VBA

מודול זה הינו הרביעי מבין ארבעת המודולים המהווים את העקרונות להערכת שווי נגזרים (PODV- Principles of Derivatives Valuation). מודול זה מקנה ידע והבנה בשימוש בשפת התכנות המובנית באקסל (Visual Basic for Applications) לביצוע הערכות שווי לאופציות ונילה ולמכשירים אקזוטיים לא סטנדרטיים.

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- בלק-שולס-מרטון
- היווניות של בלק-שולס-מרטון
- נוסחאות אנליטיות עבור אופציות אמריקאיות
- אופציות אקזוטיות על נכס בודד
- אופציות אקזוטיות על שני נכסים
- התאמות וחלופות לבלק-שולס-מרטון
- עצים ושיטות הפרשיים סופיים
- סימולציית מונטה קרלו
- אופציות על מניות המחלקות דיבידנד בדיד
- אופציות על סחורות ואנרגיה
- נגזרי ריבית
- סטיות תקן ומתאמים
- יישום באקסל של נושאי המודול

דרישות המודול:

- מעבר בהצלחה של מודול FV403
- נכחות חובה ב- 80% מהמפגשים
- הגשת תרגילי הבית
- עמידה בבחינה הסופית

בסיום המודול תוענק למשתתפים תעודת המאשרת עמידה בדרישות המודול או תעודת השתתפות מטעם לשכת מעריכי השווי והאקטוארים הפיננסיים בישראל (IAVFA)

מיקום, מועדים ועלויות:

- 8 מפגשים שבועיים + מפגש מבחן
- שעות: 16:30-21:30
- מיקום: קמפוס מכללת לוינסקי, תל אביב
- מחיר: 4,200 ש"ח + מע"מ
- מועדים: 02/11/16, 09/11/16, 16/11/16, 23/11/16, 30/11/16, 07/12/16, 14/12/16, 21/12/16