

מודול FV202: מודלים של תיקים

מודול זה הינו השני מבין ארבעת המודלים המהווים את עקרונות המידול הפיננסי בתוכנת אקסל (POFM- Principles of Financial Modeling). מודול זה מקנה כלים תיאורטיים ומעשיים בניהול תיקי השקעות, תוך שימת דגש ויישום בגיליון אלקטרוני (Excel).

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- מבוא למודלים של תיקים
- חישוב תיקים יעילים בהיעדר מגבלות על מכירה בחסר
- חישוב מטריצת שונות-שונות משותפת
- אמידת הביתא וקן ניירות הערך בשוק (SML)
- תיקים יעילים בהינתן מגבלות על מכירה בחסר
- שווי הוגן בסיכון (VaR)
- טבלאות נתונים
- מטריצות

דרישות המודול:

- מעבר בהצלחה של מודול FV201
- נוכחות 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: 18/01/16, 25/01/16, 01/02/16, 08/02/16, 15/02/16, 22/02/16, 29/02/16, 07/03/16, 14/03/16