

מודול FV401: שוקי עתידיות ואופציות

מודול זה הינו הראשון מבין ארבעת המודולים המהווים את העקרונות להערכת שווי נגזרים (PODV- Principles of Derivatives Valuation). מודול זה מקנה הוא ידע והבנה בביצוע הערכות שווי לעסקאות אקדמה, עתידיות, ואופציות.

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- מבוא לאופציות, עתידיות ונגזרים אחרים
- מכניקה של שוקי עתידיות
- אסטרטגיות גידור באמצעות עתידיות
- שערי ריבית
- קביעת מחירי עתידיות ועסקאות אקדמה
- עתידיות על שערי ריבית
- עסקאות החלפה
- מכניקה של שוקי אופציות
- מאפיינים של אופציות על מניות
- אסטרטגיות מסחר באמצעות אופציות
- עצים בינומיים
- תהליכי וינר והלמה של איטו
- מודל בלק-שולס-מרטון
- יישום באקסל של נושאי המודול

דרישות המודול:

- נוכחות חובה ב- 80% מהמפגשים
- הגשת תרגילי הבית
- עמידה בבחינה הסופית

בסיום המודול תוענק למשתתפים תעודת סיום של 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: 13/01/16, 20/01/16, 27/01/16, 03/02/16, 10/02/16, 17/02/16, 02/03/16, 09/03/16, 24/02/16