

מודול FV402: מוצרים נגזרים וניהול סיכונים

מודול זה הינו השני מבין ארבעת המודולים המהווים את העקרונות להערכת שווי נגזרים (PODV- Principles of Derivatives Valuation). מודול זה מקנה ידע והבנה בביצוע הערכות שווי למגוון רחב של מוצרים נגזרים וסיכונים המנוהלים על ידי ה- middle office של מוסדות פיננסיים.

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- שוקי נגזרים במדינות מתפתחות
- אופציות על מדדי מניות ומטבעות
- אופציות על עתידיות
- האותיות ה"יווניות"
- חיוכי תנודתיות
- פרוצדורות נומריות בסיסיות
- אמידת שווי הוגן בסיכון (VaR)
- סיכוני אשראי
- כתיבת דו"ח הערכת שווי
- כללי האתיקה, הסטנדרטים המקצועיים ותקנות אי התלות המוגדרים ב- USPAP
- יישום באקסל של נושאי המודול

דרישות המודול:

- מעבר בהצלחה של מודול FV401
- 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: 27/04/16, 20/03/16, 13/04/16, 06/04/16, 30/03/16, 23/03/16, 04/05/16, 11/05/16, 18/05/16