Fundamenten van de afgeleide financiële instrumenten

DOELSTELLINGEN

Het objectief van deze opleiding is om de deelnemer een diepgaande kennis te geven in diverse soorten afgeleide financiële instrumenten. De deelnemer wordt vertrouwd gemaakt met de concrete toepassingen en de risico's van deze afgeleide financiële instrumenten.

Deze opleiding heeft als doelstelling om:

- Inzicht te geven in de diverse soorten afgeleide financiële instrumenten, waaronder:
  - Termijncontracten,
  - Futures en Forwards,
  - Optiecontracten;
- De financiële instrumenten te leren toepassen bij:
  - Portefeuillebeheer,
  - Beheer van beveks,
  - Beheer van gestructureerde producten.

SAMENVATTING

Categorie:

- Risk, finance & treasury
- Private banking & asset management
- Financieel bedrijfsbeheer

Niveau:

Advanced

Type opleiding:

Klassikale opleiding

Prijs:

- Lid: € 575.00
- Niet-lid: € 675.00
- Partner BZB: € 575.00
- Partner Cevora: € 500.00
- Incompany: op maat, prijzen op aanvraag

Bijscholingsuren:

- Bank: **6u** sectorspecifiek

DOELGROEP

De opleiding kan gevolgd worden door verschillende doelgroepen:

- Directie, kaderleden en bedienden:
  - Verantwoordelijk voor financiële adviesverlening en/of dienstverlening aan ondernemingen of aan klanten;
  - Uit de overheid en de controleorganen;

    - Uit boekhoudkundige, juridische, fiscale, operationele en administratieve departementen.
- Leden van de Raad van Bestuur en directie van de operationele organen;
- Medewerkers van een organisme voor de financiering van pensioenen (OFP).

VEREISTE VOORKENNIS

Advanced level opleiding: Deze opleiding vereist een algemene basiskennis van het onderwerp.

Extra voorkennis vereist: Basiskennis van de afgeleide financiële producten. Je kan deze kennis verwerven aan de hand van volgende opleiding: **'Introductie tot de afgeleide financiële producten'**.

PROGRAMMA

INHOUD

Module I. Inleiding, termijncontracten

- Inleiding
    - Wat zijn afgeleide financiële instrumenten?
- Termijncontracten
    - De verschillende soorten rente
    - Obligatie ?
        - De prijs van een obligatie ?
        - De raming van het actuarieel rendement ?
        - De looptijd van een obligatie: duration ?
        - De notering
    - Aandeel ?
        - Verwachte return ?
        - Risico ?
        - Beheer van een portefeuille
    - Forwards en futures ?
        - Specificaties ?
        - Notaties ?
        - Vergelijking van forwards en futures ?
        - De huidige waarde van een forward ?
        - Afdekking met futures
    - Valuta termijncontracten: wisselkoersen
    - Forward Rate Agreement en swaps
    - Effectisering en kredietderivaten

Module II. Optiecontracten, conclusies

- Optiecontracten
    - De verschillende soorten opties
    - Overzicht van de specifiteiten bij het gebruik van opties
    - Aandelenopties
    - Obligatieopties
    - Exotische opties
    - Opties in de praktijk ?
        - Covered call ?
        - Protective put ?
        - Gestructureerd product met kapitaalbescherming ?
        - Spread strategieën
- Conclusies en appendix
    - Tabellen
    - Accounting principe

Essentiële wiskundige concepten worden uitgelegd aan de hand van concrete voorbeelden waarbij begrijpen voorrang

krijgt op berekenen.

PRAKTISCHE INFORMATIE

- **Duurtijd:** 1 lesdag (6 lesuren)
- **Uren:** 09:00 tot 17:00
- **Plaats**: Febelfin Academy: Phoenix building, Koning Albert II-laan 19, 1210 Brussel
- **Materiaal:** breng je eigen PC mee naar de opleiding.

METHODOLOGIE

Een **'Klassikale opleiding'** volg je in groep. Je bent samen met de andere deelnemers en de docent aanwezig op een afgesproken tijdstip in hetzelfde leslokaal. Er is 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, …).

Opleidingsmateriaal:

- PowerPoint presentatie
- Video
- Annotaties
- 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**.