

Introduktion til derivater

Kursus i København

Dag 1

09.00 Velkomst og præsentation

09.15 1. Introduktion til derivater

- Hvad er et derivat?
- Primære/sekundære finansielle instrumenter
- Risiko komponenter
- Brug af derivater
- Central Clearing
- Collateral
- EMIR og MIFID II

10.00 2. Futures og forwards

- Definitioner og terminologi
- Hedging og spekulation
- Hvor og hvordan handles produkterne?
- Prisfastsættelses metoder
- Opgaver

12.00 Frokost

13.00 3. Repos

- Hvad er en repo?
- Special og general collateral
- Kvotering og praktiske handelsaspekter
- Opgaver

14.00 4. Optioner

- Definitioner og terminologi
- Profit/loss diagrammer
- Intuition bag options prisfastsættelse
- Motivation for options handel
- Opgaver

16.00 Slut dag 1

Dag 2

09.00 Resumé

09.30 5. FRAs

- Hvad er en FRA?
- Motivation for handel med FRAs
- Forward renter
- Settlement og fair value beregning
- Rentefutures
- Opgaver

10.30 6. Swaps

- Hvorfor handle swaps?
- Definitioner og konventioner
- Rente-, basis-, cross currency swaps og OIS
- Byggeklodserne
- Opgaver

12.00 Frokost

13.00 7. Renteoptioner

- Interest rate guarantees (IRG'er)
- Caps, Floors og Collars
- Swaptioner
- Opgaver

14.30 8. Kreditderivater

- Handel med kredit risiko
- Kreditderivat familien
- Credit Default Swaps (CDS)

16.00 Afslutning og evaluering

Pris

Prisen for kurset er DKK 13.500 ex moms. Prisen er inklusiv kursusmateriale og forplejning.

