



Certificeret Finansiell Supporter

31. august - 1. september
14.-15. september
12.-13. oktober

København
2021



Financial
Training Partner A/S

Modul 2 – Introduktion til derivater

14. september 2021

15. september 2021

1. Introduktion til derivater

- Hvad er et derivat?
- Primære og sekundære
- OTC og central clearing

2. Futures og forwards

- Definitioner og terminologi
- Anvendelse
- Prissætning og risiko

3. Repos

- Hvad er en repo?
- Special og general collateral
- Konventioner

4. Optioner

- Definitioner og terminologi
- Tabs- og gevinstdiagrammer
- Intuitiv prissættelse

5. FRAs

- Hvad er en FRA?
- Handel og prissættelse

6. Swaps

- Definition og anvendelse
- Rentebasis
- Prissættelse

7. Renteoptioner

- IRG'er, caps, floors, collars og swap-tioner
- Handel og anvendelse

8. Kreditderivater

- Handel med kreditrisiko
- Kreditderivatfamilien
- Credit Default Swaps (CDS)

Modul 3 – Risikostyring og kontrol

12. oktober 2021

13. oktober 2021

1. Risikostyring og kontrol

- Formål med styring?
- Typer af risici

2. Lovgivning

- Kapitalkrav
- Basel III og IV
- Solvens II

3. Måling og styring af markedsrisiko

- Varighed og delta vektorer
- Volatilitet og beta værdi
- Value at Risk, stresstesting og back-testing

4. Måling og styring af kreditrisiko

- Hvor findes kreditrisiko?
- Centrale kreditparametre
 - PD, EAD, LGD og WCDR
- Kreditrisiko på derivater

5. Likviditetsrisikostyring og måling

- Anbefalinger
- GAP-analyse og stresstests
- Contingency Funding Plans

6. Operationel risikostyring

- Hvad er det og hvordan styres det?

7. Økonomisk kapital og RAROC

- Økonomisk og regulatorisk kapital
- Risk Adjusted Return on Capital

EKSAMEN

Praktisk information

Tid og sted

Uddannelsen består af tre moduler. Alle moduler afholdes i København. Undervisningstiden er fra kl. 9.00 til 16.00.

Sprog

Undervisningen foregår på dansk.

Tilmelding

Via www.FinancialTP.dk

Pris

Prisen for uddannelsen er DKK 34.000 ex. moms. Prisen er inklusiv opgaver, eksamen, kursusmateriale, forplejning og diplom.

Instruktør

Jørgen Just Andresen

Jørgen Just Andresen er adm. direktør i Financial Training Partner A/S, som han medstiftede i 2002.

Han har mange års undervisningserfaring som chefkonsulent i SimCorps kursusafdeling, hvor han startede i 1996. Før SimCorp arbejdede han i Danske Bank med salg og analyse af obligationer.

Jørgen Just Andresen er desuden ekstern lektor på CBS (Copenhagen Business School) og er kåret som årets underviser på HD, Finansiell Rådgivning. Han er forfatter til bøgerne Finansiell Risikostyring og Finansielle Derivater udgivet på DJØFs Forlag.

Han er uddannet cand.merc.int og HD(R).

Financial Training Partner A/S

Financial Training Partner er førende Skandinavisk udbyder af finansiell uddannelse og har løst opgaver for samtlige større finansielle institutioner i Skandinavien.

Vi tilbyder åbne finansielle kurser, certificerende uddannelsesforløb, kundetilpassede firmakurser, konferencer og konsulentydelse.

