

## **Instrumenty pochodne - konstrukcja i wycena, praktyczne aspekty obrotu**

---

### **Co osiągniesz poprzez udział w szkoleniu?**

- *Poznasz, jak rozwijały się instrumenty pochodne*
- *Poznasz rodzaje instrumentów pochodnych*
- *Będziesz umiał rozróżnić instrumenty OTC i Exchange Traded*
- *Nauczysz się podstaw wyceny instrumentów pochodnych*
- *Poznasz instrumenty oparte na stopie procentowej*
- *Zrozumiesz zasady działania CDS*
- *Nauczysz się rozpoznawać okazje do arbitrażu*
- *Poznasz instrumenty pochodne CDO, MBS i RMBS*
- *Będziesz potrafił dopasować instrument pochodny do potrzeb klienta*

---

### **Komu polecamy szkolenie?**

- *Doradcom bankowości osobistej, prywatnej i korporacyjnej*
- *Kierownikom zespołów doradców finansowych, zajmujących się doradztwem w obszarze produktów inwestycyjnych*
- *Osobom odpowiedzialnym za kształtowanie oferty produktowej w zakresie produktów inwestycyjnych w bankach, w spółkach dystrybuujących produkty inwestycyjne*
- *Certyfikowanym Doradcom i Planerom Finansowym EFPA jako element Programu Stałego Rozwoju Zawodowego*

### **Wymagania wstępne:**

*Podstawowa wiedza z zakresu matematyki, umiejętność posługiwania się arkuszem kalkulacyjnym Excel.*

---

### **Jak przebiegają zajęcia?**

*Zajęcia są prowadzone w formie prezentacji, ćwiczeń z wykorzystaniem komputerów oraz case study. Ćwiczenia obliczeniowe są realizowane indywidualnie. Na zakończenie każdego ćwiczenia wyniki są omawiane i interpretowane wspólnie z grupą i trenerem. Ćwiczenia bazują na wcześniej przygotowanych arkuszach Excel, które mają ułatwić przyswojenie materiału i zrozumienie mechanizmów rządzących poszczególnymi zagadnieniami. Case study dotyczą wydarzeń mających szczególny lub charakterystyczny wpływ na branżę bankową i finansową i są rzetelnie omawiane i interpretowane.*

*Po każdej sesji możesz kontynuować proces uczenia się, korzystając ze wsparcia trenera (kontakt mailowy za pośrednictwem opiekuna Studium) oraz zaglądając do „Przybornika uczestnika szkolenia WIB”. A w Przyborniku np.:*

- *Do poczytania, czyli spis lektur uzupełniających*
- *Dla przypomnienia, czyli materiał szkoleniowy w pliku pdf*

---

### **Kto prowadzi szkolenie?**

*Łukasz Woś*

### **Instrumenty pochodne - podstawy**

- *Czym jest instrument pochodny?*
- *Jak rozwijały się instrumenty pochodne*
- *Rodzaje instrumentów pochodnych*
- *ET vs OTC*
- *Future i Forward*
- *Fundamentalne różnice pomiędzy Future i Forward*
- *Charakterystyka kontraktu Forward*
- *Charakterystyka kontraktu Future*
- *Opcje*

### ***Instrumenty pochodne i ich zastosowanie***

- *Rodzaje opcji*
- *Podstawy wyceny Forward*
- *Podstawy wyceny opcji*
- *Wykorzystanie opcji*
- *Kontrakty FRA*
- *Swapy*
- *IRS*
- *CIRS*
- *CDO*
- *MBS*
- *RMBS*
- *CDS*
- *Arbitraż*
- *Analiza wpływu zmian otoczenia ekonomicznego na instrumenty pochodne*
- *Komu jaki instrument pochodny*

**Gdzie:** *Warszawa*

**Jak długo trwa:** *2 dni (16 godz. dydaktycznych)*

**Cena:** *1920 zł netto VAT zwolniony (w tym koszt obiadów)*

**Termin:** *11.05.2017 - 12.05.2017*