

№ 31433/IBA от 02.05.2024

**Коммерческое предложение
по обучению
для компании «»**

По теме:

«ДЕРИВАТИВЫ»

От International Business Academy

2024

**International Business Academy благодарит Вас за внимание к нашей компании
и предлагает ознакомиться с коммерческим предложением по организации
и проведению семинара**

Наши конкурентные преимущества:

- **Индивидуальная разработка программ под заказ**
- **Mini ассессмент + отчет (по договорённости с клиентом)**
- **Большой выбор тренеров**
- **Персональный менеджер, курирующий проект**
- **Посттренинговая поддержка 6 месяцев**
- **Программы лояльности для постоянных клиентов**
- **Высокая репутация компании IBA и рекомендации от ведущих компаний Казахстана**
- **Обучение в рамках международных стандартов**

УСЛОВИЯ СОТРУДНИЧЕСТВА:

ТОО «International Business Academy» приглашает Вас принять участие в обучении по теме:

Е-mail: info@iba.kz

Сайт: <http://www.iba.kz/> Тел.: +7 (727) 328-02-02/03; Моб. тел.: +7 702 777 4411

Адрес: РК, г. Алматы ул. Жарокова 318 офис 23 (уг. проспекта Аль-Фараби)

"Деривативы".

Стоимость обучения: 265600 тенге без НДС (Исполнитель не является плательщиком НДС).
Цена на 2025 год с учетом индексации 10% составит 292160 тенге без НДС (Исполнитель не является плательщиком НДС).

Место проведения: очно территория Поставщика/ онлайн платформа ZOOM

Даты проведения:

Алматы:

15-17 мая 2024

14-16 августа 2024

6-8 ноября 2024

6-8 марта 2025

29 сентября-1 октября 2025

Онлайн:

17-19 июля 2024

9-11 октября 2024

18-20 июня 2025

10-12 декабря 2025

Продолжительность: 24 академических часов

Время: с 10:00 до 17:30.

Количество участников: 1 человек

В стоимость обучения входит: обучение, комплект эксклюзивных обучающих материалов, блокнот, ручка, сертификат International Business Academy, посттренинговая поддержка (6 месяцев), обед и 2 кофе-брейка в каждый день занятий (при условии, что обучение очное).

Просим заключить договор заранее как минимум за 1-2 месяца до начала обучения и забронировать даты с тренером.

Исполнитель: Батухтина Н.Е



Информация о компании.

International Business Academy– это:

1. Рекомендации. Высокая репутация компании IBA и рекомендации от ведущих компаний Казахстана. Компания более 10 лет на рынке за это время зарекомендовала себя, как надежного поставщика услуг.
2. Персональный менеджер, курирующий проект. Каждый проект курирует отдельный менеджер, который закреплен за Вашей компанией
3. Лучшие эксперты. Профессиональный состав привлекаемых к процессу обучения преподавателей, успешных экспертов, консультантов, топ-менеджеров крупных корпораций.
4. Актуальность и польза. Наши программы отражают самые современные методики с учетом изменения рынка и законодательства.
5. Формат обучения. Мы предлагаем нашим клиентам несколько форматов обучения:
— Очный и Онлайн формат открытых, корпоративных и индивидуальных семинаров.
6. Пост-тренинговые анализ и поддержка в течении 6 месяцев. Мониторинг результатов тренингов в рабочем процессе, рекомендации от тренера.
7. Индивидуальный подход. Все, начиная от содержания, места и времени проведения тренингов может быть настроено в соответствии Вашим потребностями.
8. Принципиально высокий уровень сервиса. Мы создали все условия для максимального вовлечения в обучение: от удобных кресел и современного презентационного оборудования, до удобной локации.
9. Международные стандарты обучения. Обучение в рамках международных стандартов, с адаптаций под реалии казахстанского бизнеса.

ОПИСАНИЕ ПРОГРАММЫ:

1 день

Основные концепции будущей стоимости денег и математической статистики

- Настоящая и будущая стоимость, дисконтирование
- Аппроксимация изменения цены облигаций с фиксированным купоном рядом Тейлора
- Функции плотности распределения вероятности.

Е-mail: info@iba.kz

Сайт: <http://www.iba.kz/> Тел.: +7 (727) 328-02-02/03; Моб. тел.: +7 702 777 4411

Адрес: РК, г. Алматы ул. Жарокова 318 офис 23 (уг. проспекта Аль-Фараби)

Практикум: закрепление базы математической статистики

VAR — стоимость под риском, методы расчета

- Дельта — нормальный метод
- Метод исторического моделирования
- Метод Монте-Карло
- Практическое применение VAR для управления рисками

Практикум: отработка методики VAR

Производные финансовые инструменты

- Основные тенденции рынка производных финансовых инструментов и структурных продуктов
- Общие понятия, определения рынка производных инструментов
- Оценка форвардного и фьючерсного контрактов
- Практические примеры применения форвардных и фьючерсных контрактов
- Свопы. Определение, оценка. Применение свопов для управления рисками
- Опционы пут/колл, внутренняя и внешняя стоимость опционов
- Оценка Блэка-Шоулза

Практикум: закрепление навыков расчета производных финансовых инструментов

2 день

Производные кредитные инструменты

- Классификация. Свопы активов и совокупного дохода (TRS). Практическое применение в качестве инструментов управления кредитными рисками
- Дефолтные кредитные свопы и опционы
- Продукты кредитного спреда (форварды, опционы)
- Структурные продукты
- Коллатерализованные долговые обязательства (CDO)
- Кредитные ноты (CLN)
- Практические примеры использования производных кредитных инструментов и структурных продуктов

Практикум: закрепление навыков расчета производных кредитных инструментов

Проблема арбитража и стратегии хеджирования

- Коэффициент хеджирования
- Совершенное хеджирование
- Коэффициент хеджирования с минимальной дисперсией

- Получение коэффициента хеджирования с минимальной дисперсией
- Оценка коэффициента хеджирования с минимальной дисперсией
- Регрессия OLS
- Оптимальное число контрактов
- Эффективность хеджирования
- Хеджирование при нормально распределенной доходности (корректировка коэффициента бета)
- Хеджирование несколькими фьючерсными контрактами
- Простые ответы на вопросы о хеджировании с помощью фьючерсов

Практикум: закрепление приемов хеджирования

Модели определения цены опционов

- Формула Блэка-Шоулза для оценки опционов
- Европейские опционы на акции, по которым выплачивается известный дивиденд
- Европейские опционы на акции, дивиденд по которым неизвестен
- Американские опционы на акции, по которым выплачивается известный дивиденд
- Опционы на биржевые индексы
- Опционы на фьючерсы
- Валютные опционы
- Варранты

3 день

Модели определения цены опционов (продолжение)

- Биномиальная модель определения цены
- Европейские опционы колл за один период до экспирации
- Европейские опционы колл более чем за один период до экспирации
- Европейский опцион пут
- Американские опционы пут и колл
- Ограниченность результатов биномиальной модели
- Возможные расширения биномиальной модели

Практикум: определение цены опционов

Анализ чувствительности опционных премий

- Цена базового актива, коэффициенты дельта и гамма
- Пример стратегий дельта-хеджирования и дельта-гамма-хеджирования
- Время до срока погашения и θ
- Процентная ставка и ρ
- Волатильность доходностей по акции и вега

Волатильность, экзотика и опционные стратегии

- Определение волатильности по ретроспективным данным
- Подразумеваемая волатильность и «улыбка волатильности»
- Опцион, не зависящий от пути
- Сложный опцион
- Опцион выбора
- Цифровой опцион
- Опцион обмена
- Опционы, зависящие от пути
- Барьерные опционы
- Азиатские опционы
- Опцион «с оглядкой назад»
- Определение цены экзотических опционов численными методами
- Опционные стратегии: Спреды, Стрэнглы, Стрэдлы

Практикум: выработка опционной стратегии