Introduktion til investeringsrisici

Kursus i København

Dag 1

09.00 **Velkomst og introduktion**

09.15 **1. Typer af finansielle investorer og deres risici**

- Hvordan defineres investeringsrisici og hvad driver dem?
- Kreditinstitutter
- Livsforsikring- og pensionsselskaber
- Skadesforsikringsselskaber
- UCITS og AIF'er

10.00 **2. Porteføljeprocessen**

- Strategisk, taktisk og operationelt niveau
- Investeringsstrategi
- Performance måling og attribution analysis

11.00 **3. Markedsrisici**

- Rente- og inflationsrisici
  - Varighedsnøgletal og nøglerentevarighed
  - Konverterbare realkreditobligationer
  - Afdækning med derivater
- Aktierisici
  - Cycliske og defensive aktier
  - Volatiliitet og beta
  - Faktorrisici
    - Value, growth, momentum mm
  - Afdækning med derivater
- Valutarisici
  - Hvor meget bør man afdække?
  - Adækning med FX-swap, FX-forwards og Cross Currency Swaps
- Risk budgeting
- Bæredygtighedsrisici

12.00 Frokost

13.00 **3. Markedsrisici, fortsat**

16.00 **Afslutning dag 1**

Dag 2

09.00 **Resumé**

09.30 **4. Likviditetsrisici**

- Hvordan måler man likviditet og likviditetsrisiko?
- Myndigheders krav til likviditetsrisiko
- Styring af likviditetsrisiko

10.30 **5. Risici ved brug af derivater**

- Operationel risiko
- Likviditetsrisiko
- Modpartsrisiko
- Hvordan styrer man risici på derivater?

12.00 **Frokost**

13.00 **6. Geopolitiske risici**

- Eksempler på geopolitiske risici
- Hvordan udmønter geopolitiske risici sig?
- Hvordan måles de?
- Hvordan skabes en "all-weather-portefølje"?

14.00 **7. Risici på alternative investeringer**

- Typer af alternative investeringer og deres risici
- Myndighedernes krav
- Hvordan adskiller risici på alternative investeringer sig fra børsnoterede investeringer?
- Måling af og styring af risici på alternative investeringer

15.00 **8. Stresstest af porteføljer**

- Fordele og ulemper ved stresstesting
- Hvordan måler man det uforventede?
- Drawdown, følsomhedsanalyse, makro-stresstest, stress-to-fail

16.00 **Afslutning på kurset og evaluering**

Pris

Prisen for kurset er DKK 13.500 ex moms. Prisen inkluderer kursusmateriale, frokost og forfriskninger.

Phone: +45 70 23 23 10
Email: info@FinancialTP.com
Website: www.FinancialTP.com

Financial Training Partner A/S