

Data:
5 maja 2022

Miejsce:
Hotel Bristol, Warszawa

Instrumenty pochodne jako narzędzia zarządzania ryzykiem przedpłat kredytów hipotecznych.

Zaawansowane metody wyceny pochodnych stopy procentowej.

Prowadzący:

Prof. dr hab. Dariusz Gątarek

"Wykład skierowany jest do specjalistów od metod ilościowych w finansach zwanych po angielsku quantitative analyst albo quant. Zawód ten istnieje od początku lat 80-tych, od połowy lat 90-tych metody ilościowe w bankach są traktowane bardzo poważnie.

Celem wykładu nie jest przedstawienie polskim analitykom ogólnie, elementarnie i przyjaźnie naszkicowanych podstaw teorii ale jej twardego jądra – tak by byli w stanie rozmawiać na równych pozycjach z analitykami londyńskimi.

Dobrym wprowadzeniem jest organizowane przez CEETA szkolenie autorstwa Wojciecha Ślusarskiego „Instrumenty Pochodne Stopy Procentowej.”

Jest to autorska wersja zwięzłego ale kompletnego wykładu na temat modelowania stóp procentowych. Jego wcześniejsze wersje były prezentowane w trakcie szkoleń w wielu krajach świata. W Polsce będzie on wygłoszony po raz pierwszy.

Szkolenie przeznaczone jest dla profesjonalnych analityków ilościowych już obeznanymi z takimi pojęciami matematycznymi jak równania różniczkowe, rachunek prawdopodobieństwa, procesy stochastyczne i optymalizacja." - *Dariusz Gątarek*

PATRONAT:



Prof. dr hab Dariusz Gątarek

Ukończył matematykę stosowaną na Politechnice Warszawskiej w roku 1981, obecnie jest profesorem w Instytucie Badań Systemowych PAN. Dariusz Gątarek spędził ponad 20 lat w wielu instytucjach finansowych i doradczych w Polsce, Anglii i Niemczech takich jak BRE Bank, Societe Generale, Glencore, UniCredit, Deloitte i NumeriX zajmując się wyceną instrumentów finansowych i zarządzaniem ryzykiem. W latach 2008-2010 pracował też jako doradca prezesa NBP a w latach 2016-2020 był przewodniczącym komitetu ryzyka rady nadzorczej Alior Banku. Jest autorem licznych publikacji z dziedziny finansów (a także matematyki, fizyki i automatyki) w międzynarodowych pismach i częstym prelegentem na konferencjach w wielu krajach świata. Jego praca 'The market model of interest rate dynamics', z Alanem Brace i Markiem Musielą jest powszechnie cytowana i uznawana za wynik klasyczny. Jest współtwórcą polskiego rynku instrumentów pochodnych.

CEETA

CEETA specjalizuje się w organizacji najwyższej klasy warsztatów szkoleniowych, seminariów, wykładów i konferencji z zakresu rynków finansowych. Od 2003 roku zrealizowaliśmy ponad 500 zaawansowanych merytorycznie, eksperckich sesji szkoleniowych i seminariów. Współpracujemy ze środowiskiem eksperckim z Polski, Europy i Stanów Zjednoczonych. Ponad 10 000 osób wzięło udział w wydarzeniach organizowanych przez nasz zespół. Wsłuchujemy się w opinie klientów, stale śledzimy tendencje oraz funkcjonowanie interesujących nas obszarów tematycznych i staramy się wychodzić naprzeciw oczekiwaniom uczestników rynku stawiając reputację i doskonałość za priorytet.

Zaufali nam m.in.:

ACCENTURE	CEZ
AMREST	PGNiG
UKNF	GRUPA LOTOS
BANK HANDLOWY	PKN ORLEN
BANK PEKAO	SANTANDER
BGK	ING BANK SŁĄSKI
BNP PARIBAS	DNB
BUDIMEX	mBANK
CAN PACK	PKO BP
HSBC	MOL
KGHM POLSKA MIEDŹ	FITCH RATINGS
ZGH BOLESŁAW	ALLEN & OVERY
EY	CLIFFORD CHANCE
BANK MILLENNIUM	PZU
DELOITTE	GENERALI
CAIXA BANK	AVIVA

PROGRAM:

- Rynek stóp procentowych: charakteryzacja i podstawowe instrumenty
- Podstawy matematyczne: struktura terminowa stóp procentowych, warunek braku arbitrażu, miara forward
- Model Heatha Jarrowa Mortona: warunki braku arbitrażu dla stóp forward
- Modele krótkiej stopy procentowej: model Vasiczka/Hulla-White'a, model Coxa-Ingersolla-Rossa, model Blacka-Karasińskiego
- Model Brace'a Gątarka i Musieli: standard rynku stopy procentowej, wycena caps, floors i swaptions
- Model Cheyette'a
- Wzór Dupire'a dla stóp procentowych
- Wycena opcji bermudzkich

Zajęcia rozpoczynają się o godzinie 9:00 i kończą ok. 17:00. W trakcie zaplanowano dwie 20 min przerwy kawowe i 1h przerwę na lunch.

Instrumenty pochodne jako narzędzia zarządzania ryzykiem przedpłat kredytów hipotecznych

Zaawansowane metody wyceny pochodnych stopy procentowej

Prosimy wypełnić formularz i przesłać na adres:

registration@ceeta.pl

Firma: _____

Adres: _____

Imię i nazwisko: _____

Stanowisko: _____

Departament: _____

Telefon: _____

E-mail: _____

Imię i nazwisko: _____

Stanowisko: _____

Departament: _____

Telefon: _____

E-mail: _____

Imię i nazwisko: _____

Stanowisko: _____

Departament: _____

Telefon: _____

E-mail: _____

Imię i nazwisko: _____

Stanowisko: _____

Departament: _____

Telefon: _____

E-mail: _____

Data:
5 maja 2022

Miejsce:
Hotel Bristol, Warszawa

Cena:
1300 PLN + VAT / osoba



Formularz zgłoszeniowy
dla Członków Stowarzyszenia
ACI Polska

SPOSÓB PŁATNOŚCI:

Przelew bankowy
mBank S.A.
Nr konta: 31 1140 2017 0000 4102 1305 4692

FAKTURA:

Oświadczamy, że jesteśmy płatnikiem VAT, nasz nr NIP _____ i upoważniamy firmę CEETA - Central and Eastern Europe Training Advisory do wystawienia faktury VAT bez naszego podpisu.

Oświadczamy, że nie jesteśmy płatnikiem VAT.

Wyrażamy zgodę na wystawienie i przesyłanie faktury w formie elektronicznej:

TAK na adres: _____

NASZ ADRES:

ul. Grzybowska 4/217, 00-131 Warszawa
tel.: 22 114 01 42 ; info@ceeta.pl

Podpis

Data i pieczęć

Wyrażamy zgodę na przetwarzanie naszych danych osobowych przez firmę CEETA Central and Eastern Europe Training Advisory w zakresie prowadzonej przez nią działalności gospodarczej.

W przypadku rezygnacji prosimy o kontakt najpóźniej pięć dni roboczych przed rozpoczęciem seminarium.

Zgłoszenie rezygnacji po terminie wiąże się z poniesieniem pełnej opłaty jak za uczestnictwo. Istnieje możliwość zastępstw.

CEETA zastrzega sobie prawo do zmiany daty, prowadzących oraz odwołania seminarium w razie nieprzewidzianych wcześniej i niezależnych od organizatora okoliczności.