

Opleiding : Beheer van renterisico

Praktijkcursus - 2d - 14u00 - Ref. RTX

Nieuwe praktijken in het beheer van renterisico's hebben geleid tot een groot aantal veranderingen in financiële instrumenten en processen. Deze cursus richt zich op rentemarkten en afdekkingsinstrumenten en biedt je de kennis en tools die je nodig hebt om renterisico's te beheren.

Pedagogische doelstellingen

Aan het einde van de training is de deelnemer in staat om:

- ✓ Inzicht in de spelers op de rentemarkt
- ✓ Begrijp de uitdagingen van effectief renterisicobeheer voor uw bedrijf
- ✓ Je renterisico beheren

Doelgroep

Penningmeesters, financieel managers of accountants.

Voorafgaande vereisten

Goede kennis van algemene boekhouding

Praktische modaliteiten

Praktisch werk

In deze cursus, die is gebaseerd op rollenspellen en casestudy's, leer je de vaardigheden die nodig zijn om renterisico's te beheren.

Opleidingsprogramma

1 Definitie van renterisico

- De verschillende spelers op de rentemarkt.
- De definitie van renterisico.
- Verschillende soorten blootstelling identificeren.

Praktisch werk

Collectieve reflectie en discussie over de rentemarkt.

DEELNEMERS

Penningmeesters, financieel managers of accountants.

VOORAFGAANDE VEREISTEN

Goede kennis van algemene boekhouding

VAARDIGHEDEN VAN DE CURSUSLEIDER

De deskundigen die de cursus leiden zijn specialisten op het betreffende vakgebied. Zij werden geselecteerd door onze pedagogische teams zowel om hun vakkennis als hun pedagogische vaardigheden voor elke cursus die zij geven. Zij hebben minstens vijf tot tien jaar ervaring in hun vakgebied en oefenen of oefenden verantwoordelijke bedrijfsfuncties uit.

BEOORDELINGSMODALITEITEN

De cursusleider beoordeelt de pedagogische vooruitgang van de deelnemer gedurende de gehele cursus aan de hand van meerkeuzevragen, praktijksituaties, praktische opdrachten, ...
De deelnemer legt ook van tevoren en naderhand een test af ter bevestiging van de verworven kennis.

2 Renterisico beoordelen

- Rentekasstroomprognoses.
- Globale en statische risicoanalyse.
- Elementen van concurrentievermogen.
- Invloed op de balans en winst-en-verliesrekening.

Praktisch werk

Casestudy over de verschillende methoden om het renterisico te beoordelen.

3 Proces in kaart brengen en risico's identificeren

- Risico's identificeren.
- Bruto- en restrisico.
- De typologie van risico's: endogeen en exogeen, inherent ...
- Risico's in kaart brengen.
- Proces in kaart brengen.

Praktisch werk

Casestudy over het in kaart brengen van risico's en processen.

4 Beleid renterisicobeheer

- Drempels voor kredietdekking.
- Keuze tussen vaste instrumenten en opties.
- Controleren of de dekkingsdoelen worden gehaald.
- Governance en opstellen van een managementcharter.
- Definitie van dekkingsparameters.

Praktisch werk

Opstellen van een managementhandvest.

5 De belangrijkste afdekkingsinstrumenten

- Natuurlijke afdekking: beleggingen compenseren met indexgekoppelde contracten.
- Contante transacties.
- Derivaten.
- Renteswaps.
- Renteopties: cap-floor en swaption.
- Gestructureerde en hybride producten.
- Het gebruik van ISDA-FBF benchmarks.

Praktisch werk

Toepassing van de verschillende afdekkingsinstrumenten.

6 Het opzetten en beheren van het interne controlesysteem

- De rol en verschillende componenten van de interne controleomgeving.
- De rol van de Raad van Bestuur en het Auditcomité.
- De implementatie van een intern controlesysteem in het proces van risicobeheer en -vermindering.
- De verschillende soorten controle.
- Risicomanagement: monitoringindicatoren en de rol van de risicomanager.

Casestudy

Implementatie van een intern controlesysteem.

PEDAGOGISCHE EN TECHNISCHE MIDDELEN

- De gebruikte pedagogische middelen en cursusmethoden zijn voornamelijk: audiovisuele hulpmiddelen, documentatie en cursusmateriaal, praktische oefeningen en correcties van de oefeningen voor praktijkstages, casestudies of reële voorbeelden voor de seminars.
- Na afloop van de stages of seminars verstrekt ORSYS de deelnemers een evaluatievragenlijst over de cursus die vervolgens door onze pedagogische teams wordt geanalyseerd.
- Na afloop van de cursus wordt een presentielijst per halve dag verstrekt, evenals een verklaring van de afronding van de cursus indien de stagiair alle sessies heeft bijgewoond.

TOEGANGSMODALITEITEN EN TERMIJNEN

De inschrijving dient 24 uur voor aanvang van de cursus plaatsgevonden te hebben.

TOEGANKELIJKHEID VOOR MINDERVALIDEN

Is voor u speciale toegankelijkheid vereist? Neem contact op met mevr. FOSSE, contactpersoon voor mindervaliden, via het adres psh-accueil@ORSYS.fr om uw verzoek en de haalbaarheid daarvan zo goed mogelijk te bestuderen.

