

بوت کمپ تخصصی

بازار مشتقه

گروه مالی کارآمد



بوت کمپ مشتقه گروه مالی کارآمد یک دوره تخصصی و کاربردی برای آشنایی عمیق با بازار مشتقه و تبدیل مفاهیم تئوریک به مهارت‌های عملی است. در این دوره، شرکت‌کنندگان از مبانی قراردادهای مشتقه و کاربردهای آن در پوشش ریسک و تأمین مالی آغاز کرده و با ارزش‌گذاری، استراتژی‌های معاملاتی، عملیات بازار و الزامات قانونی آشنا می‌شوند.

همچنین کارگاه عملی با بازپخش بازار فعال؛ رصد و شبیه‌سازی معامله، تحلیل معاملات، انتقال تجربه و اصلاح فرآیند طی دوره برگزار شده و پس از برگزاری آزمون و ارائه پروژه نهایی گواهی‌نامه معتبر به شرکت‌کنندگان اعطا خواهد شد.

زمان برگزاری:

روزهای شنبه و دوشنبه از ۲۱ شهریور

ساعت برگزاری:

۵۴ ساعت (۹ هفته)

نحوه برگزاری:

به صورت آنلاین

هدف ما چیست؟

تمرکز ویژه دوره بر بازار مشتقه ایران، بورس کالا و ابزارهای نوین تحلیل است و در کنار مباحث تخصصی، استفاده از پایتون برای دریافت داده، قیمت‌گذاری، محاسبه Greeks و بکتست استراتژی‌ها نیز آموزش داده می‌شود. در پایان، شرکت‌کنندگان دیدی جامع و عملیاتی نسبت به ساختار بازار مشتقه و ابزارهای موردنیاز برای تحلیل و فعالیت حرفه‌ای در این بازار خواهند داشت.

بازار مشتقه ایران و بورس کالا



تحلیل و بکتست با پایتون



مهارت عملی در بازار مشتقه



۱ مفاهیم و انواع قراردادهای مشتقه

- مبانی بازار مشتقه و شناخت انواع قراردادها
- قراردادهای مشتقه در بازار ایران

۲ پوشش ریسک و تأمین مالی با مشتقه

- طراحی پوشش ریسک و کاربردهای تأمین مالی

۳ ارزش‌گذاری مشتقه

- قیمت‌گذاری قراردادهای آتی و مفهوم آربیتراژ
- ارزش‌گذاری اختیار معامله و حساسیت‌ها

۴ استراتژی‌های مشتقه

- استراتژی‌های پایه اختیار معامله
- استراتژی‌های ترکیبی و معامله نوسان

۵ عملیات بازار مشتقه

- ساختار بازار، ارکان و مدیریت وجه تضمین
- ثبت سفارش، تسویه و مدیریت کال مارجین

۶ مشتقه در بورس کالا

- قراردادهای آتی کالایی و ارتباط با بازار نقدی
- اختیار معامله کالایی و پوشش ریسک تولیدکننده

۷ دستورالعمل‌ها و قوانین مشتقه

- چارچوب مقرراتی و الزامات فعالیت در بازار مشتقه

۸ پایتون و مشتقه

- دریافت داده و محاسبات پایه مشتقه با پایتون
- قیمت‌گذاری اختیار، Greeks و بک‌تست استراتژی

۹ سایت‌ها و ابزارهای مشتقه

- سامانه‌های رصد، داده و تحلیل بازار مشتقه



مهدی خجسته
مدرس مرکز مالی شریف



ناهید زمانی
مدرس مرکز مالی ایران



علی پورفاضل
کارشناس سرمایه‌گذاری مشتقه
کارگزاری کارآمد



رضا شیخی
کارشناس ارشد مشتقه
سبدگردان کارآمد



محمد حقانی نسب
معاون سرمایه‌گذاری کارگزاری کارآمد

برای ثبت نام، از طریق لینک زیر اقدام کنید.

بوت کمپ تخصصی بازار مشتقه

