



CURSO IN COMPANY

MÓDULO SENIOR

Executivos com responsabilidades nas áreas comerciais, financeira, tesouraria, *traders* com mais de cinco anos de experiência que estão familiarizados com os mercados derivativos, *controllers* e auditores que precisam conhecer com profundidade os mecanismos de proteção existentes no mercado, gestores de risco, profissionais na área de crédito, investidores, conselheiros de empresas, jornalistas que cobrem os mercados de commodities, estudantes dos cursos de graduação, pós-graduação, MBA e demais pessoas interessadas.

Conteúdo programático:

1. Apreçamento de Opções
 - Variáveis que afetam o prêmio
 - Black & Scholes
 - O método binomial
 - Distribuição normal
2. Volatilidade
 - Implícita e histórica
 - Cálculo
 - Diferentes volatilidades
3. As gregas
4. Delta Hedging
 - Conceito
 - Ajustes
 - Comparando com futuros
 - Relação tempo/volatilidade
5. Operações Sintéticas
 - A matemática das opções
 - Put/call parity
6. Estratégias
 - Direcional
 - Volatilidade
 - Estruturando uma estratégia vencedora

Tempo de duração: De 10 a 12 horas

Instrutor: Arnaldo Luiz Corrêa