

RISICOMANAGEMENT

en de werking van termijnmarkten



Termijnmarkten worden gebruikt als informatiebron of als instrument om risico's af te dekken bij grote prijsstijgingen of -dalingen. Maar hoe werken termijn- en optiemarkten nu echt en hoe kunt u ze zelf [optimaal] gebruiken?

De Commodity Risk Management Academy organiseert trainingen voor professionals die in hun werk te maken hebben met risicomanagement en het verhandelen van grondstoffen. De praktische trainingen geven veel kennis en inzicht. Deelnemers geven aan na de training strategisch veel sterker te zijn en het instrument goederentermijnmarkten veel beter te benutten.

Wilt u leren hoe de termijnmarkten functioneren? Wilt u uw strategie evalueren en optimaliseren? Wilt u door risicomanagement uw bedrijfsresultaat verbeteren? Kom dan naar de trainingen met Joost Pennings als docent.

MASTERCLASS niveau III

Datum
1 oktober 2021

Investering
€ 995,- excl. BTW

Inschrijven voor
**uiterlijk 3 weken voorafgaand
aan de training**
op volgorde van aanmelding

Taal
Nederlands
met achtergrondartikelen en
lesmateriaal in het engels

Locatie
WICC Wageningen

INFORMATIE EN AANMELDEN
commodity-rm-academy.nl

VRAGEN?
Gerianne Jansen
+31 [0]6 - 53 69 64 70



Effectief hedgen voor professionals

De Commodity Risk Management Academy organiseert op 1 oktober 2021 een masterclass over risicomanagement in goederen-, termijn- en optiemarkten. Na afloop van de masterclass bent u in staat om uw strategie op de termijnmarkten te evalueren en te optimaliseren. Risicomanagement wordt nu een opportuniteit om uw bedrijfsresultaat te verbeteren.

Docent van de Commodity Risk Management Academy is **prof. dr ir Joost M.E. Pennings**. Een autoriteit op het gebied van prijsrisicomanagement en de werking van de termijnmarkten.

Doel van de training is het verschaffen van inzicht en begrip in de werking van de grondstoffentermijnmarkten. De doelgroep van deze training is iedereen die als professional betrokken is bij het handelen in grondstoffen en/of beleggen in de grondstoffentermijnmarkten. Bijvoorbeeld inkopers, handelaren, directie, accountants en beleidsmedewerkers. Om optimaal rendement uit de training te halen is enige basiskennis van termijnmarkten gewenst.

Expert als Trainer

Professor Pennings is een autoriteit op het gebied van risicomanagement en het gebruik van instrumenten voor risicomanagement met bijzondere aandacht voor grondstoffen en energiedragers. Eén van zijn drijfveren is het geven van inzicht in het functioneren van goederentermijnmarkten.

Prof. dr ir Joost M.E. Pennings

- AST professor in de Theorie en Praktijk van Goederen-termijnmarkten aan de Wageningen Universiteit
- Hoogleraar Marktkunde en Besliskunde aan de Universiteit van Illinois in de Verenigde Staten
- Professor in Behavioral Finance en Hoogleraar Marktkunde aan de Universiteit van Maastricht



De masterclass is een verdiepende training. In deze training leert u hoe u risicomanagement in kunt zetten voor het verbeteren van uw bedrijfsresultaat. De masterclass beantwoordt de volgende vragen:

- Welke factoren gaan de grondstoffenmarkten in de toekomst beïnvloeden?
- Wat is de impact van de verschillende marktpartijen op prijzen en de hedging effectiviteit?
- Hoe kunt u beschikbare marktinformatie optimaal interpreteren?
- Hoe moet ik bijvoorbeeld de Commitments of Traders rapporten lezen?
- Hoe kan ik deze gebruiken bij mijn hedging strategie?
- Hoe bepaalt u de risicoreductiecapaciteit van een strategie (Hedging Effectiveness)?
- Hoeveel van de onderliggende grondstof dient u af te dekken (Hedge Ratio)?
 - Hoe kan ik een cross hedge maken?
 - Op welke wijze kan ik mijn marge en winstrisico afdekken?
 - Hoe benut ik optimaal kansen?
- Hoe kan risicomanagement het financiële resultaat verbeteren?

Programma

1 oktober 2021

De masterclass begint om 9.00 uur en eindigt om 17.00 uur met een informele afsluiting.

Onderwerpen:

- Hedging
- Basisrisico
- Rolling hedge
- Marktdiepte risico
- Fixed/flexibele prijscontracten
- Opties & optiestrategieën
- Basiscontracten
- Swaps
- Exchange for physicals
- Rol van speculanten
- Welke informatie op welke wijzen gebruiken (o.a. COT reports)
- Hedgingsoftware



TRAININGS AANBOD

De trainingen kennen drie niveaus:

Introductietraining (niveau I)

Basistraining (niveau II)

Masterclass (niveau III)

De trainingen zijn ook als leergang te volgen. Kijk voor alle data op www.commodity-rm-academy.nl

commodity
risk management
Academy