



29 ביוני 2018

הערה של מנהל סיכונים פיננסיים: מסחר דינמי

השכפול הדינמי של פוזיציות Long באופציה באופן סיסטמטי קונה לאחר שהמחיר כבר עלה ומוכר לאחר שהמחיר כבר ירד. תהליך זה חייב להפסיד כסף, בסכום אשר מייצג פרמיה על אופציה המחושבת על בסיס סטיית התקן שהתממשה, דהיינו, בפועל (חלף סטיית התקן הגלומה)

להרחבה בנושאים אלו ניתן לפנות לתוכניות ההסמכה השונות של הלשכה בתחומי האקטואריה הפיננסית.

בכבוד רב,

רוני פולניצר, אקטואר

מנכ"ל לשכת מעריכי השווי והאקטוארים הפיננסיים בישראל

 WWW.IAVFA.ORG



רחוב נתן ברניצקי 5, ראשון לציון 7524205, ישראל



077-5070590



153-77-5070590



IAVFA1020@GMAIL.COM