

## מודול FA207: אקטואריית סיכונים תפעוליים

מודול זה הינו מודול ההתמחות של תוכנית ה- ORA (Operational Risk Actuary) והוא מקנה ידע והבנה בביצוע מיפוי, מידול, מדידה וניהול סיכונים תפעוליים, סיכוני נזילות, סיכוני מודל וסיכונים אינטגרטיביים.

### להלן עיקר נושאי הלימוד:

- מבוא לסיכונים תפעוליים
- הרחבת גישת ה- VaR לסיכונים תפעוליים
- יישום גישת התפלגות ההפסדים (LDA)
- סיכוני מודל
- התאמת הסיכון התפעולי של באזל 2 לפרוייקטים של SOX
- ניהול סיכונים כולל (ERM): תיאוריה ופרקטיקה
- הקצאת הון ומדידת ביצועים
- מדידת סיכונים, ניהול סיכונים והלימות כלכלית בקונצרנים פיננסיים
- סיכוני נזילות ואמידת סיכוני נזילות
- מה אנו יודעים, לא יודעים ולא יכולים לדעת על סיכונים בבנק
- עקרונות לניהול תקין של סיכוני נזילות
- סיכונים תפעוליים בבאזל 2 וסולבנסי 2
- יישום באקסל של נושאי המודול

### דרישות המודול:

- מעבר בהצלחה של מודול FA204
- נוכחות חובה ב- 80% מהמפגשים
- הגשת תרגילי הבית
- הגשת דו"ח ORA
- עמידה בבחינת ההסמכה ל- ORA

בסיום המודול תוענק למשתתפים תעודת המאשרת עמידה בדרישות המודול או תעודת השתתפות מטעם לשכת מעריכי השווי והאקטוארים הפיננסיים בישראל (IAVFA)

### מיקום, מועדים ועלויות:

- 8 מפגשים שבועיים + מפגש מבחן
- שעות: 16:30-21:30
- מיקום: קמפוס מכללת לוינסקי, תל אביב
- מחיר: 4,200 ש"ח + מע"מ
- מועדים: 01/09/16, 08/09/16, 15/09/16, 22/09/16, 29/09/16, 06/10/16, 13/10/16, 20/10/16, 27/10/16