

מודול FA206: אקטואריית סיכוני אשראי

מודול זה הינו מודול ההתמחות של תוכנית ה- CRA (Credit Risk Actuary) והוא מקנה ידע והבנה בביצוע מיפוי, מידול, מדידה וניהול סיכוני אשראי.

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- סוכנויות הדירוג ודירוגים חיצוניים ופנימיים
- מודלים לסיכוני מדינה וסיכוני ריבונות
- תיק הלוואות והפסד צפוי, הפסד בלתי צפוי וסיכוני אשראי
- הרחבת גישת ה- VaR להלוואות
- סיכון חדלות פירעון: מתודולוגיות כמותיות וההפסד בהינתן חדלות פירעון
- מבוא לגישות של תיק, הון כלכלי והקצאת הון
- יישומים לגישות של תיק ואפקטים של תיק: תרומות לסיכון והפסדים בלתי צפויים
- מדידת סיכוני צד נגדי, נגזרי אשראי ושטרות צמודי אשראי
- תהליך האיגוח, CDO מזומן, CDO סינטטי
- מחקרים אודות ריכוזיות סיכוני אשראי והבנת איגוח משכנתאות הסאבפריים
- בחינת יכולת הפירעון והאיתנות הפיננסית של חברה
- סיכוני אשראי 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 CRA
- עמידה בבחינת ההסמכה ל- CRA

בסיום המודול תוענק למשתתפים תעודת המאשרת עמידה בדרישות המודל 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