

יו"ר הלשכה - רועי פולניצר, מנהל סיכונים



השכלה

- בעל תואר ראשון (B.A.) בכלכלה עם התמחות בניתוח מכשירים פיננסיים וניהול תיקי השקעות מאוניברסיטת בן-גוריון (בהצטיינות).
- בעל תואר שני (M.B.A.) במנהל עסקים עם התמחות באקטואריה וניהול סיכונים מאוניברסיטת בן-גוריון (בהצטיינות).
- בעל דיפלומה בניהול סיכונים פיננסיים (FRM®) מאוניברסיטת אריאל בשומרון (250 שעות).
- בעל הסמכת "מנהל סיכונים פיננסיים" (FRM) מהאיגוד העולמי למומחי סיכונים (GARP).
- בעל הסמכת "מנהל סיכונים מוסמך" (CRM) מהאיגוד הישראלי למנהלי סיכונים (IARM).
- בעל הסמכת "מדען נתונים מקצועי" (PDS) מהאיגוד הישראלי למדעני נתונים מקצועיים (PDSIA).
- אקטואר מלא (Fellow) בלשכת מעריכי השווי והאקטוארים הפיננסיים בישראל (F.I.L.A.V.F.A.).
- בעל הסמכות "אקטואר סיכוני שוק" (MRA), "אקטואר סיכוני אשראי" (CRA) ו-"אקטואר סיכוני השקעות" (IRA) מטעם לשכת מעריכי השווי והאקטוארים הפיננסיים בישראל (IAVFA).



polanitz8@gmail.com

13 שנות ניסיון בתחומי המימון, ניהול הסיכונים, האופציות וההנדסה הפיננסית

ניסיון מקצועי

- בעל ניסיון מקצועי רב משנת 2007 בטכניקות מדידת וניהול סיכוני שוק: מודלים מבניים עבור איגרות חוב וחשיפות לתנודתיות, Market VaR (אנליטי, היסטורי ומונטה קרלו), Expected Shortfall ומדדי סיכון קוהרנטיים, קורלציות וקופולות, שיטות אמידה פרמטריות וא-פרמטריות, תורת הערך הקיצון (EVT), הערכת שווי אופציות אקזוטיות ואג"ח מגובות משכנתא (MBS).
- מימון מובנה ומוצרי אשראי (CDO ונגזרי אשראי), סיכון אשראי צד נגדי (CVA), מתודולוגיות למדידת סיכון חדלות פירעון (PD ו-LGD) ו-Credit VaR (לרבות עבור סיכון הגירת אשראי).
- מדידה, ניהול והפחתת סיכונים תפעוליים, אמידת דרישות הון כלכלי, הקצאת הון מבוסס סיכונים, ניהול סיכוני נזילות, סיכוני מודל, תיקוף מודלים של VaR, מבחני קיצון, באזל וסולבנסי.
- מומחה בעריכת חוות דעת מימוניות בנושאים: בניית תיקי השקעות, ניתוח ביצועים, תיקצוב סיכונים, Portfolio VaR ו-Component VaR, קרנות גידור והשקעות Private Equity.

