

מודול FA208: אקטואריית סיכוני השקעות

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

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- בניית תיקים
- ניתוח ביצועים
- ניטור סיכונים ומדידת ביצועים
- סיכוני תיק: שיטות אנליטיות
- VaR ותקצוב סיכונים בניהול השקעות
- תקצוב סיכונים עבור קרנות פנסיה ומנהלי תיקים באמצעות VaR
- אסטרטגיות של קרנות גידור
- קרנות גידור: עבר, הווה ועתיד
- קרנות של קרנות גידור
- ניטור, זיהוי ובקרה: (Style Drifts) סטיות סגנון
- יישום באקסל של נושאי המודול

דרישות המודול:

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

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