

מודול FA205: אקטואריית סיכוני שוק

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

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- מדדים לסיכונים פיננסיים ומידול התלות: מתאמים וקופולות
- תיקוף מודלים של VaR
- מיפוי VaR
- גישות פרמטריות: הערך הקיצון
- מדדים לרגישות המחיר מבוססי שינויי תשואות מקבילים
- חשיפות לשערי ריבית מפתח ולדליים
- המדע של מודלים לאמידת המבנה העתי של שערי הריבית
- סקירה על משכנתאות ושל שוק המשכנתאות
- אג"ח מגובות משכנתאות והערכת שווי אג"ח מגובות משכנתאות
- חיוכי תנודתיות
- הערכות שווי וניתוח סיכונים לדו"ח גלאי 2
- סיכוני שוק 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 MRA
- עמידה בבחינת ההסמכה ל- MRA

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