

Finans, Yatırım ve Risk Yönetimi



Genel Bilgiler

| | |
|-------------------|--------------------|
| Kontenjan | 10 |
| Ücret | 1650,00 TL |
| Eğitmen | Emine Feray Sezgin |
| Eğitim Kategorisi | 3. Seviye |

Eğitimin Amacı

Sigorta ve emeklilik şirketlerinin belli sayıda aktüeri istihdam etme zorunluluğu ve piyasadaki aktif aktüer sayısının azlığı bu alandaki aktüer talebini artırmaktadır.

Aktüerlik Sınavlarına Yönelik Eğitim Programları, Hazine ve Maliye Bakanlığının her yıl iki kez dört ayrı seviyede ve bu seviyelere ait branşlarda düzenlediği sınavlara yönelik bir hazırlık programıdır. Bu Eğitim Programları ile aktüer adaylarının, ilgili konu başlıklarına ait temel kavramları ve bunların aktüerya alanındaki uygulamalarını kavraması, soru tarzlarına alışkanlık sağlanması ve çözüm tekniklerini öğrenmesi sağlanarak ilgili sınavları başarıyla geçmeleri amaçlanmaktadır.

Eğitimin Hedef Kitlesi

3. Seviye Aktüerlik sınavlarına hazırlanan aktüer adayları.

✚ Eğitimin İçeriği

1. Finansal Risk Yönetimi

Finansal Riskler

Piyasa riski

Kredi riski

Likidite riski

Faaliyet riski

Yasal risk

Finansal Risklerin Ölçümü

Riske maruz değer (VaR, RMD)

Kuyruk riske maruz değeri (TvaR)

Sermaye varlıkları fiyatlandırma modeli (CAPM) ve etkin sınır (efficient Frontier)

2. Aktüeryal Risk Yönetimi

Aktüeryal Yükümlülüklerle İlişkin Riskler

Varlık temerrüt riski (Asset Default Risk)

Sigorta riskleri

Ölümlülük riski

Morbidite riski

Faiz oranı riski

Garanti edilmiş faiz oranı riski (Guarantee risk)

Likidite riski

Faiz aralığı riski

Karlılığın Ölçümü ve Analizi

Dağıtılabilir kazancın (temettü) hesaplanması

Kazancın ölçümü

Gömülü değer (Embedded Value)

Yatırımların getirisi (ROI)

Varlıkların ağırlıklı ortalamalı getirisi (ROE)

Primlerin belirli bir oranı olarak kar

Gelirlerin belirli bir oranı olarak kar

Risk masraflarının belirli bir oranı olarak kar

Rezenlerin belirli bir oranı olarak kar

Yükümlülüklerin Modellenmesi

Yükümlülük modelleme yöntemleri (Fiyatlama, Yeni iş, Yürürlükteki Model)

Yükümlülük modeli hesaplamaları

Yükümlülük modeli değerlemesi

Yükümlülük modeli sonuçları

Bütünleşik modeller

Varlık Modellemesi

- Varlık modelleme yöntemleri

Varlık Yeterliliği (asset adequacy)

Serbest Nakit Akışı (free cash flows)

- Varlık modeli değerlemesi

- Varlık modeli sonuçları

Varlık – Yüklümlülük Eşleştirmesi

Tam Eşleştirme Yöntemi

Durasyon Eşleştirme Yöntemi

Eksen Eşleştirme Yöntemi (Horizon Matching)

Ürün Nakit Akışı Eşleştirmesi

1.3. Monte Carlo Yöntemleri (Monte Carlo Methods), Stress testi, Backtesting

1.4. Solvency II (Tanımsal Çerçeve)

3 sütunlu yapı

Teknik karşılıklar, en iyi tahmin, risk marjı

Hedef sermaye (Solvency capital requirement (SCR))

Minimum hedef sermaye (minimum capital requirement (MCR))

Temel hedef sermaye (basic solvency capital requirement (BSCR))

Faiz oranı (interest rate), öz sermaye (equity), mal (property), döviz (currency), spread, likidite yetersizliği prim (illiquidity premium risk) riski

Ölüm oranı (mortality), uzun yaşama (longevity), maluliyet (disability), hastalık oranı (morbidity), lapse, gider (expense), değişiklik (revision) riski

Katastrofik olay riski (Catastrophe risk).

📅 Eğitim Takvimi

| Tarih | Mekan |
|--|---------------|
| 27 Haziran 2019 Perşembe 17:00<>27 Haziran 2019 Perşembe 20:30 | Kırmızı Salon |
| 28 Haziran 2019 Cuma 17:00<>28 Haziran 2019 Cuma 20:30 | Kırmızı Salon |
| 29 Haziran 2019 Cumartesi 10:00<>29 Haziran 2019 Cumartesi 14:00 | Kırmızı Salon |
| 06 Temmuz 2019 Cumartesi 10:00<>06 Temmuz 2019 Cumartesi 14:00 | Turuncu Salon |
| 08 Temmuz 2019 Pazartesi 17:00<>08 Temmuz 2019 Pazartesi 20:00 | Kırmızı Salon |

📍 SALON : Kırmızı Salon

📍 SALON : Turuncu Salon