

Finans, Yatırım ve Risk Yönetimi (ONLINE)



Genel Bilgiler

Kontenjan	20
Ücret	6550,00 TL
Eğitmen	Emine Feray Sezgin - SEDDK Başkan Yardımcısı
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, Sigortacılık ve Özel Emeklilik Düzenleme ve Denetleme Kurumu'nun SEGEM vasıtasıyla her yıl iki kez üç ayrı seviyede ve 13 farklı alanda 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

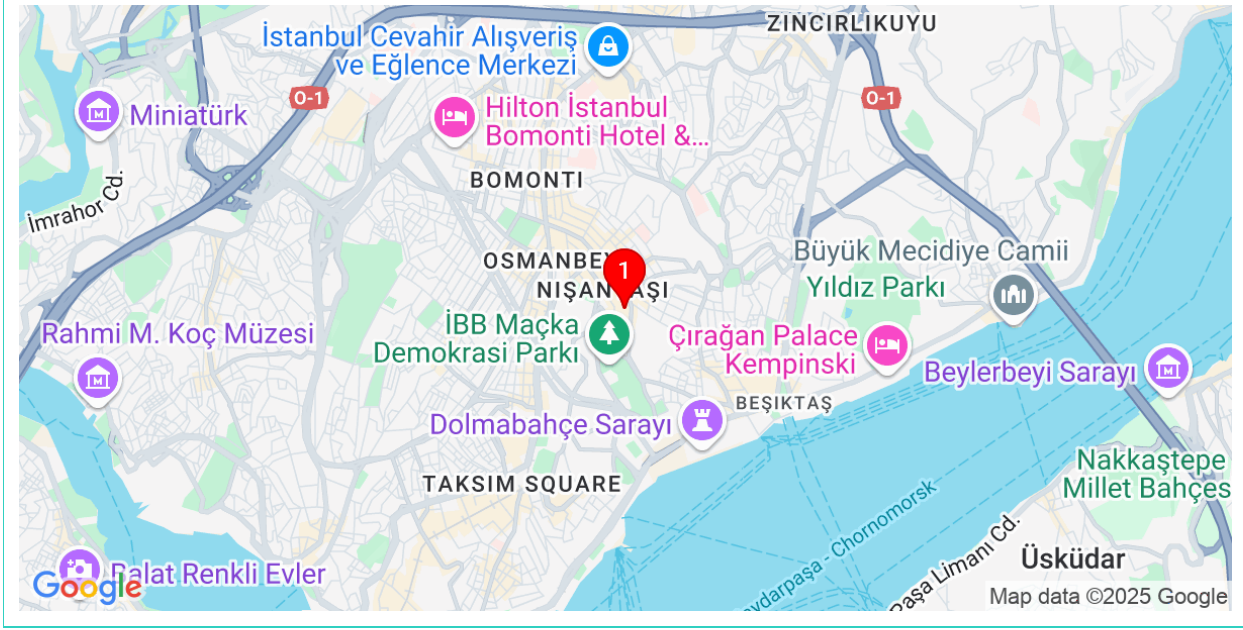
Ölüm oranı (mortality), uzun yaşama (longevity), maluliyet (disability), hastalık oranı (morbidity), lapse, gider (expense), değişiklik (revision) riski

Katastrofik olay riski (Catastrophe risk).

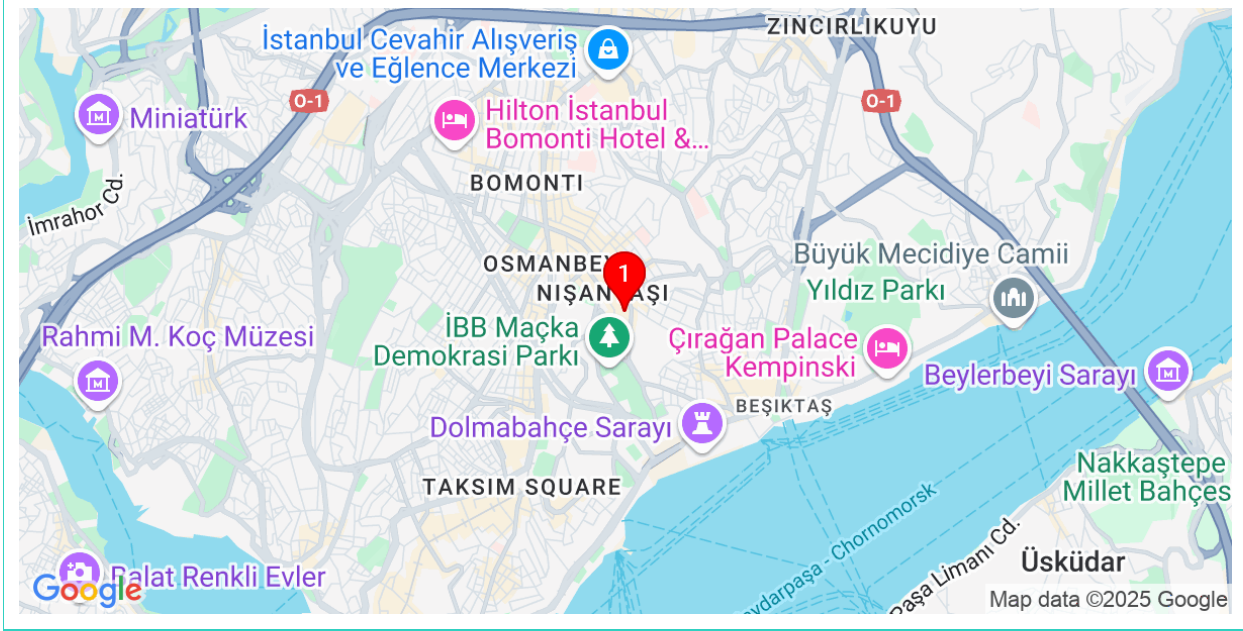
Eđitim Takvimi

Tarih	Mekan
15 Eylöl 2023 Cuma 18:00<>15 Eylöl 2023 Cuma 21:00	Mavi Salon
16 Eylöl 2023 Cumartesi 09:00<>16 Eylöl 2023 Cumartesi 12:00	Mavi Salon
21 Eylöl 2023 Perşembe 18:00<>21 Eylöl 2023 Perşembe 21:00	Turuncu Salon
23 Eylöl 2023 Cumartesi 09:00<>23 Eylöl 2023 Cumartesi 12:00	Mavi Salon
26 Eylöl 2023 Salı 18:00<>26 Eylöl 2023 Salı 21:00	Kırmızı Salon
01 Ekim 2023 Pazar 09:00<>01 Ekim 2023 Pazar 12:00	Mavi Salon

📍 SALON : Mavi Salon



📍 SALON : Turuncu Salon



📍 SALON : Kırmızı Salon

