

Finans, Yatırım ve Risk Yönetimi (ONLINE)



Genel Bilgiler

Kontenjan	10
Ücret	2500,00 TL
Eğitmen	Emine Feray Sezgin - Sigortacılık Uzmanı
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

Öümlüük riski

Morbidite riski

Faiz oranı riski

Garanti edilmiş faiz oranı riski (Guarantee risk)

Likidite riski

Faiz aralığı riski

Karlılığın Ölçümü ve Analizi

Dağıtlabilir 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
22 Eylöl 2021 arşamba 17:00<>22 Eylöl 2021 arşamba 20:00	Mavi Salon
24 Eylöl 2021 Cuma 17:00<>24 Eylöl 2021 Cuma 20:00	Mavi Salon
25 Eylöl 2021 Cumartesi 10:00<>25 Eylöl 2021 Cumartesi 13:00	Kırmızı Salon
27 Eylöl 2021 Pazartesi 17:00<>27 Eylöl 2021 Pazartesi 20:00	Mavi Salon
29 Eylöl 2021 arşamba 17:00<>29 Eylöl 2021 arşamba 20:00	Turuncu Salon
02 Ekim 2021 Cumartesi 10:00<>02 Ekim 2021 Cumartesi 13:00	Turuncu Salon

📍 SALON : Mavi Salon



📍 SALON : Kırmızı Salon



📍 SALON : Turuncu Salon

