

מודול FA204: מודלים להערכת שווי ואקטואריה פיננסית

מודול זה הינו הרביעי מבין ארבעת המודולים המהווים את עקרונות האקטואריה הפיננסית (POFAS- Principles of Financial Actuarial Science). מודול זה מקנה ידע בטכניקות להערכת שווי ובמודלים לניתוח סיכונים.

להלן עיקר נושאי הלימוד:

- מחירי איגרות חוב, גורמי היוון וארביטראז'
- מחירי איגרות חוב, שערי ריבית מידיים ושערי ריבית עתידיים
- שיעור התשואה לפדיון ומדדים חד-גורמיים לרגישות המחיר
- עצים בינומיים, מודל בלק-שולס-מרטון והאותיות ה"יוניות"
- מבוא לשווי הוגן בסיכון (VaR) ושיטות של VaR
- סיכון חיזוי וכימות התנודתיות במודלים של VaR
- יישום מודל ה-VaR ומבחי מאמץ
- עקרונות לביצוע ופיקוח על מבחי מאמץ
- אופציות אקזוטיות
- יישום באקסל של נושאי המודול

דרישות המודול:

- מעבר בהצלחה של מודול FA203
- נוכחות חובה ב- 80% מהמפגשים
- הגשת תרגילי הבית
- עמידה בבחינה הסופית

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: 05/05/16, 12/05/16, 19/05/16, 26/05/16, 02/06/16, 09/06/16, 16/06/16, 23/06/16, 30/06/16