



info@ifsa.org.ir

کارگاه آموزشی
مبانی مدیریت ریسک بازار،
ریسک نقدینگی و مدیریت دارایی و بدهی
در شرکت‌های بیمه در ایران

تلفن دفتر انجمن مالی ایران: ۰۶۱۱۱۶۶۷۰
۰۹۱۹۲۵۹۸۶۹۹



مدیر اجرایی دوره:

لعیاملکیان

دانشجوی دکتری مالی دانشگاه تهران و پژوهشگر صنعت بیمه



مدرس دوره:

آقای دکتر بهنام شهریار

دکتری اقتصاد، مشاور مدیرعامل در امور مدیریت ریسک و عضو کمیته ریسک در شرکت‌های بیمه



آقای دکتر علی نمکی

دکتری مالی، هیئت علمی دانشکده مدیریت دانشگاه تهران و عضو کمیته ریسک بنگاه‌های مالی مختلف (بانک، لیزینگ و...)



سیلابس کارگاه آموزشی مبانی مدیریت ریسک بازار، ریسک نقدینگی و مدیریت دارایی و بدهی در شرکت‌های بیمه در ایران

۱- ریسک بازار

- تعاریف، دسته‌بندی و بررسی مفهوم انواع ریسک بازار (ریسک‌های نرخ بهره، نرخ تورم، نرخ ارز، قیمت سهام و ...)
- مفاهیم احتمال، تبدیل‌های آماری و نوسان‌پذیری (Volatility)
- داده‌های ریسک بازار و نحوه کار با آنها
- آیین‌نامه‌ها و قوانین مرتبط با ریسک بازار در صنعت بیمه (آیین‌نامه‌های سرمایه‌گذاری، ذخایر، ...)

۲- ریسک نقدینگی

- ریسک نقدینگی: مفاهیم، شاخص‌ها و ابزارهای اندازه‌گیری
- مروری بر مفاهیم نقدینگی و نقدشوندگی در شرکت‌های بیمه
- مدیریت ریسک نقدینگی در شرکت‌های بیمه
- الزامات کفایت سرمایه و سالونسی در حوزه ریسک بازار

۳- مدیریت دارایی و بدهی

- مقدمه ای بر مفاهیم مدیریت دارایی و بدهی
- معرفی دارایی‌ها و بدهی‌های شرکت‌های بیمه (بررسی از نظر نقدینگی) و ارتباط بین اقلام صورت‌های مالی با یکدیگر
- مرور اجمالی بر مدل‌های موجود جهت مدیریت دارایی‌ها و بدهی‌ها در شرکت‌های بیمه

۴- مدل‌سازی ریسک بازار با نرم‌افزار اکسل و ایویوز

- مفهوم دیرش (Duration)
- مدل‌های تک عاملی و چندعاملی
- مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای (CAPM)
- مهمترین سنجه‌های ریسک بازار:
- وارianس و نیم‌وارianس
- ارزش در معرض ریسک (VaR)
- ارزش در معرض ریسک دمی (TVaR)
- مدلسازی ارزش در معرض ریسک (VaR)
- روش واریانس-کوارianس
- شبیه‌سازی مونت کارلو (MCS)
- مدلسازی واریانس ناهمسانی (GARCH و EWMA, ARCH)
- ارزش در معرض ریسک پرتفولیو (Portfolio VaR)

۵- بررسی برخی روش‌های کاربردی مدیریت ریسک بازار با نرم‌افزار اکسل:

- بهینه‌سازی پرتفولیوی سرمایه‌گذاری‌های بیمه‌گر
- مدیریت دارایی-بدهی (ALM): شکاف دیرش
- مدیریت دارایی-بدهی (ALM): بهینه‌سازی پرتفولیوی سرمایه‌گذاری‌ها مبتنی بر بدهی‌های بیمه‌گر

- بهینه‌سازی پرتفولیوی سرمایه‌گذاری‌های بیمه‌گر
- مدیریت دارایی-بدهی (ALM): شکاف دیرش
- مدیریت دارایی-بدهی (ALM): بهینه‌سازی پرتفولیوی سرمایه‌گذاری‌ها مبتنی بر بدهی‌های بیمه‌گر



معرفی کارگاه آموزشی مبانی مدیریت ریسک بازار ریسک نقدینگی و مدیریت دارایی و بدهی در شرکت‌های بیمه در ایران

ضرورت برگزاری کارگاه:

- پس از برگزاری کارگاه آموزشی مقدمه‌ای بر مفاهیم ریسک در شرکت‌های بیمه، کارگاه مدیریت ریسک بیمه‌گری و کارگاه ریسک عملیاتی، به ریسک بازار، نقدینگی و مدیریت دارایی و بدهی پرداختیم.
- با توجه به ضرورت شناسایی، اندازه‌گیری و مدیریت ریسک‌های بازار و نقدینگی و مدیریت دارایی و بدهی در شرکت‌های بیمه، کمیته بیمه انجمن مالی ایران با همکاری سندیکای بیمه‌گران ایران اقدام به طراحی و برگزاری کارگاه آموزشی مدیریت ریسک بازار، ریسک نقدینگی و مدیریت دارایی و بدهی در شرکت‌های بیمه نموده است.

هدف از برگزاری کارگاه:

- هدف از برگزاری کارگاه، آشنایی با مفاهیم ریسک‌های بازار، نقدینگی و مدیریت دارایی و بدهی، تحلیل و سنجش ریسک‌های مذکور با استفاده از نرم‌افزار اکسل و ایویوز و کنترل و کاهش ریسک‌ها در شرکت‌های بیمه است.

مخاطبان:

مخاطبان عمومی این کارگاه، دانشجویان رشته‌های مدیریت مالی، مدیریت بیمه و فعالان صنعت بیمه کشور و مخاطبان تخصصی کارشناسان ریسک و فنی، مدیران ارشد، مدیران مالی و مدیران ریسک شرکت‌های بیمه هستند.

هزینه شرکت در کارگاه آموزشی:

مدت و هزینه دوره: ۱۲ ساعت و ۱،۸۰۰،۰۰۰ تومان به ازای هر نفر دوره به صورت حضوری و در روزهای سه‌شنبه مورخ ۱۶ اسفندماه ۱۴۰۱ ساعت ۱۴ الی ۱۸ و روزهای شنبه و دوشنبه مورخ ۲۰ و ۲۲ اسفندماه ۱۴۰۱ ساعت ۱۴ الی ۱۸ برگزار می‌گردد. مکان برگزاری کارگاه: ساختمان سندیکای بیمه‌گران ایران جهت ثبت نام با شماره تلفن‌های دفتر انجمن مالی تماس حاصل فرمایید.