

Szczegółowy program 1. dnia szkolenia nr 6, 8 lipca 2010

Tytuł szkolenia: Ocena prawdopodobnych skutków zrealizowania się ryzyka za pomocą testów stresu oraz wyznaczanie kapitałów niezbędnych do pokrycia strat wynikających ze zrealizowania się ryzyka

Godzina	Prelegent	Zakres tematyczny
9.00-10.30	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none">• Integracja scenariuszy• Typy scenariuszy (odwrotne, globalne, historyczne, syntetyczne, specyficzne dla zakładu, o pojedynczym zdarzeniu, wielozdarzeniowe)• Przykłady zależności• Metody kalibracji stresów, walidacja (weryfikacja parametrów),• Konstruowanie scenariuszy i ich dobór pod kątem profilu działalności zakładu.• Globalny finansowy scenariusz (parametry zewnętrzne i wewnętrzne)
10.30-10.45		Przerwa
10.45-12.15	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none">• Przykłady scenariuszy (Lloyd's, Bermuda, FED, Swiss Pandemic Scenario)• Apetyt na ryzyko i kalibracja wydarzenia ekstremalnego• Wartość narażona na ryzyko (Value at risk), runoff kapitału, runoff z wyceną przejściową• Częstość niewypłacalności obligacji oraz apetyt na ryzyko• Dane dostępne do oszacowania• Ryzyka akcji i nieruchomości
12.15-13.00		Lunch
13.00-14.45	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none">• Cykle składek i rezerw• Stresy umieralności / długowieczności oparte na liczbie zgonów• Stresy umieralności / długowieczności oparte na błędzie parametru• Podejścia do ryzyk przedłużenia umowy / zachowania ubezpieczonych:<ul style="list-style-type: none">- Przykład: przygotowanie scenariuszy do testów stresu dla polskiego rynku , jak sprawdzić spójność wyników testów stresu
14.45-15.00		Przerwa
15.00-17.00	Marcin Szczuka	<ul style="list-style-type: none">• Przykład 6A1: Modelowanie ryzyka kredytowego w obligacjach korporacyjnych• Przykład 6A2: Modelowanie zachowań dynamicznych

Szczegółowy program 2. dnia szkolenia nr 6, 9 lipca 2010

Tytuł szkolenia: Ocena prawdopodobnych skutków zrealizowania się ryzyka za pomocą testów stresu oraz wyznaczanie kapitałów niezbędnych do pokrycia strat wynikających ze zrealizowania się ryzyka

Godzina	Prelegent	Zakres tematyczny
9.00-10.30	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none">• Integracja scenariuszy• Typy scenariuszy (odwrotne, globalne, historyczne, syntetyczne, specyficzne dla zakładu, o pojedynczym zdarzeniu, wielozdarzeniowe)• Przykłady zależności• Porównanie metodologii przeprowadzania testów stresu w zakładach ubezpieczeń zgodnie z obecnymi zasadami wyceny i rachunkowości i zgodnie z metodologią dyrektywy Wyłącalność II na przykładzie ryzyka stopy procentowej, śmiertelności, rezygnacji z umów, katastroficznego.• Globalny finansowy scenariusz (parametry zewnętrzne i wewnętrzne)
10.30-10.45		Przerwa
10.45-12.15	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none">• Przykłady scenariuszy (Lloyd's, Bermuda, FED, Swiss Pandemic Scenario)• Apetyt na ryzyko i kalibracja wydarzenia ekstremalnego• Wartość narażona na ryzyko (Value at risk), runoff kapitału, runoff z wyceną przejściową• Częstość niewypłacalności obligacji oraz apetyt na ryzyko• Dane dostępne do oszacowania• Ryzyka akcji i nieruchomości
12.15-13.00		Lunch
13.00-14.45	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none">• Modele katastroficzne- uwzględnienie reasekuracji• Cykle składek i rezerw• Stresy umieralności / długowieczności oparte na liczbie zgonów• Stresy umieralności / długowieczności oparte na błędzie parametru• Podejścia do ryzyk przedłużenia umowy / zachowania ubezpieczonych:<ul style="list-style-type: none">- Przykład: przygotowanie scenariuszy do obliczeń testów stresu; sprawdzenia spójności wyników bilansu i rachunku zysków i strat
14.45-15.00		Przerwa
15.00-17.00	Marcin Szczuka	<ul style="list-style-type: none">• Przykład 6B1: Modelowanie ryzyka kredytowego w obligacjach korporacyjnych• Przykład 6B2: Modelowanie zachowań dynamicznych