

Sigortacılıkta Risk Yönetimi

Öğretim Üyeleri: Dr. Genco Fas, Prof. Dr. Cenktan Özyıldırım

Süre: 12 saat, 2 gün

İçerik:

1. Gün – Dr. Genco Fas

Temel Risk ve Getiri Kavramları

Risk Ölçütleri: Beklenen Değer(Getiri) ve Volatilite

Riske Maruz Değer (VaR) ve Kuyruk Riske Maruz Değeri (TVaR)
Hayat ve Hayat Dışı Sigortalardan Uygulamalar

Muafiyetli Sigortalarda Risk Kavramı ve Hasar Eleme Oranı
Hayat Dışı Sigortalardan Uygulamalar

2. Gün – Prof. Dr. Cenktan Özyıldırım

Portföy Riski

Beklenen Getiri ve Risk Değişim Katsayısı

Beta Faktörü

Beklenen Getiri ve Piyasa Riski İlişkisi

Portföy ve Portföy Yönetimi Kavramları

Portföy Getirisi ve Çeşitlendirme

Finansal Varlık Fiyatlama Modeli (CAPM) - opsiyonel

Arbitraj Fiyatlama Teorisi - opsiyonel