

مدل سازی ریسک عملیاتی در شرایط کمبود داده

معرفی دوره:

ریسک عملیاتی یکی از قدیمی ترین و مهمترین انواع ریسک است که موسسات مالی و بانک ها با آن مواجه می باشند. اهمیت این ریسک به اندازه ای است که کمیته نظارت بانکی بال در بازنگری مقررات کفایت سرمایه (بال II) این ریسک را بعنوان یکی از ریسکها در محاسبات مربوط به کفایت سرمایه بانک ها وارد نموده است. این ریسک ناشی از نامناسب بودن و عدم کفایت فرآیندها و روشها، افراد و سیستم های داخلی و یا ناشی از وقوع رویدادهای خارج از موسسات مالی و بانکها می باشد. به دلایل گوناگون در محاسبه و مدل سازی ریسک عملیاتی با کمبود داده مواجه هستیم. لذا این دوره برای پرداختن به چنین شرایطی تدوین شده است.

اهداف دوره:

- بررسی روشهای متعارف تخمین تابع توزیع ریسک عملیاتی در بانک
- محاسبه سرمایه مورد نیاز ریسک عملیاتی با رویکرد بیزین

محتوای دوره:

- مقدمه ای بر ریسک عملیاتی و رویکرد بیزین
- ریسک عملیاتی در بانکهای کشور و رویکرد بازل ۲ به ریسک عملیاتی
 - مروری بر روش بیزین و کاربردهای آن در شرایط کمبود داده
 - مزایا و پیش نیازهای ریسک عملیاتی با روش بیزین
 - روشهای تخمین تابع توزیع ریسک عملیاتی با رویکرد بیزین
 - روش Bootstrapping به ریسک عملیاتی در رویکرد بیزین
 - استفاده از نظریه باورمندی (credibility theory) در رویکرد بیزین
- مروری بر نحوه پیاده سازی رویکرد بیزین در روش توزیع زیان
- نحوه ترکیب چندین پایگاه داده ای برای کمی سازی ریسک عملیاتی با استفاده از رویکرد بیزین
 - نحوه دخیل نمودن نظرات خبرگان در کمی سازی ریسک عملیاتی با رویکرد بیزین
 - نحوه ترکیب چندین پایگاه داده با استفاده از نظریه باورمندی
 - محاسبه سرمایه مورد نیاز با استفاده از توزیعهای پیش گوینانه روش بیزین و بررسی چند مورد مطالعاتی R
 - مروری بر نحوه پیاده سازی رویکرد بیزین در نرم افزار اکسل

مخاطبان دوره:

کارشناسان ادارات ریسک و ادارات بازرسی و کنترل های داخلی

پیشنیاز دوره: فاقد پیشنیاز

مدت دوره: ۱۶ ساعت

تاریخ برگزاری:

۲۵ و ۲۶ تیر ۱۳۹۶ (از ساعت ۸/۳۰ الی ۱۶/۳۰)

هزینه دوره:

۳.۹۰۰.۰۰۰ ریال

هزینه برگزاری شامل محتوای آموزشی، پذیرایی میان وعده، ناهار و صدور گواهینامه می باشد.



مدیریت آموزش های حرفه ای

آدرس: تهران، خیابان پاسداران، بالاتر از ایستگاه ضرابخانه، پلاک ۱۹۵

شماره های تماس: ۲۷۸۹۱ داخلی: ۲۴۵۸-۲۴۵۷-۲۴۹۸-۲۴۹۷

www.ibi.ac.ir

Telegram.me/ibi_ac_ir