

Пятая Весенняя школа по управлению рисками, страхованию и финансам в Санкт-Петербурге

В Санкт-Петербурге организована Весенняя школа по управлению рисками, страхованию и финансам. Цель школы состоит в распространении новых знаний и результатов современных исследований в заявленных областях. Приглашение в качестве лектора школы направляется ведущим специалистам, а также лицам, недавно защитившим докторскую диссертацию. Тематика выбирается в соответствии с последними публикациями приглашенного лектора. Преимущество отдается тем результатам, где имело место применение экономико-математических методов и других современных аналитических инструментов, в частности актуарных моделей.

Целевой группой являются представители профессионального сообщества актуариев и риск-менеджеров, а также студенты, аспиранты и молодые преподаватели из России и других стран. Это позволит им лучше понять современные направления развития экономической и финансовой науки, количественного риск-менеджмента, актуарных методов и финансового моделирования. Хотя школа ориентирована прежде всего на участников из стран СНГ, прилагаются усилия по привлечению слушателей из других стран и регионов.

Формат, выбранный для школы, предполагает чтение однодневного курса (6–8 акад. часов) по одному из заявленных направлений – финансам (финансовой математике), управлению рисками (количественному риск-менеджменту) и страхованию (актуарным моделям). Это позволяет учесть интересы тех участников, которые хотят посетить только часть программы (один или два курса из трех). Такой формат достаточно уникален для мероприятий подобного рода, что также выгодно отличает данную школу от аналогичных мероприятий в России и за рубежом.

В 2016 году школа организуется уже в пятый раз. Она будет проходить в период с 17 по 19 марта 2016 года на базе Европейского университета в Санкт-Петербурге. Рабочий язык – английский.

Доминик Беккерс (Dominique Beckers) из Бельгии представит лекции по некоторым актуарным аспектам пенсионного обеспечения (на основе материалов ЕЮРА – европейского агентства по надзору за страховыми компаниями и пенсионными фондами). Они будут касаться как особенностей проведения стресс-тестинга в пенсионных фондах, так и увязки проблем коммуникации с оценками пенсионных обязательств. Рогер Лэвен (Roger Laeven) из Нидерландов представит микроэкономические основания риск-менеджмента и финансовой теории. Олег Русаков (Oleg Rusakov) из России расскажет о модификациях финансовых моделей, учитывающих специальные формы зависимости во времени, что позволяет делать обоснованные прогнозы для ситуаций, где классические финансовые модели не работают (в частности, для ценообразования недвижимости). Сайт школы: <http://eu.spb.ru/en/econ/projects/srmif>

Участие пока бесплатное. Регистрация до 9 марта (если нужна российская виза – до 17 февраля). Для регистрации нужно написать секретарю школы Лине Коротковой (lkorotkova@eu.spb.ru). Она может также помочь с бронированием гостиниц и т.п.

Школа входит в систему ППК Гильдии актуариев. В 2016 году по решению Комитета по квалификации и образованию за каждый курс (длительностью один день) назначается 20 баллов (то есть максимум 60 баллов за всю школу). К членам Гильдии просьба дополнительно написать А.А. Кудрявцеву для организации учета баллов ППК (kudr@AK1122.spb.edu).