





## กำหนดการอบรม

### หลักสูตร "การบริหารความเสี่ยงเชิงปฏิบัติการ" รุ่นที่ 9

วันที่ 11-12 กรกฎาคม 2556 ณ ห้องประชุมราชมัย ชั้น 1 โรงแรมอะริสตัน สุขุมวิท 24

#### วันพฤหัสบดีที่ 11 กรกฎาคม 2556

- 08.30 - 08.45 น. ลงทะเบียน-รับเอกสาร แนะนำและเปิดหลักสูตร
- 08.45 - 09.00 น. แนะนำวิทยากร และเปิดหลักสูตร  
โดย นายอาหาร เจริญหลาย ผู้จัดการสมาคมกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
- 09.00 - 16.00 น.
- \* ความเสี่ยงทางการเงิน : คำนิยาม ปัจจัยที่ทำให้เกิดความเสี่ยง
    - Business Risk
    - Financial Risk
      - market risk
      - credit risk
      - liquidity risk
    - Operational Risk
    - Legal Risk Risk Management
  - \* Risk Management
    - Understanding of Your financial situation
    - Understanding sources of risk and potential risk
    - Understanding of risk management tools
  - \* Risk Management and Risk Measurement: Limits, Duration, VaR, Stress Test, etc
  - \* Risk & Return ของสินทรัพย์ทางการเงินแต่ละประเภท

#### วันศุกร์ที่ 12 กรกฎาคม 2556

- 08.45 - 09.00 น. ลงทะเบียน
- 09.00 - 16.00 น.
- \* แนวคิดพื้นฐานเกี่ยวกับการสร้างกลุ่มหลักทรัพย์ลงทุน (Portfolio Formation)
  - \* ความหมายและความสำคัญของการลงทุนเป็นกลุ่มหลักทรัพย์
  - \* แนวคิดการคำนวณผลตอบแทนและความเสี่ยงของกลุ่มหลักทรัพย์
  - \* ทฤษฎีการสร้างกลุ่มหลักทรัพย์ของ Markowitz
  - \* แนวคิดการคำนวณ efficient portfolio และ optimize port แนวทางการค้นหาระดับความเสี่ยงที่
  - \* ยอมรับได้ในการลงทุน ลักษณะพอเหมาะการลงทุนที่เหมาะสมกับระดับความเสี่ยงของนักลงทุน
  - \* WORKSFIP : การคำนวณหาอัตราผลตอบแทน และความเสี่ยงของหลักทรัพย์ และกลุ่มหลักทรัพย์
  - \* ตัวอย่างการจัด Asset Allocation โดยควบคุมระดับความเสี่ยง
  - \* การติดตามผลการดำเนินงานของผู้จัดการกองทุน

#### วิทยากรผู้บรรยาย

นายพิชัย เลิศสุพงศ์กิจ ผู้ช่วยผู้จัดการฝ่ายการตลาด บริษัทหลักทรัพย์ อนาคต จำกัด (มหาชน)



- |                                     |                       |
|-------------------------------------|-----------------------|
| พักรับประทานอาหารว่าง (รอบเช้า) พัก | เวลา 10.30 - 10.45 น. |
| รับประทานอาหารว่าง (รอบบ่าย) พัก    | เวลา 14.30 - 14.45 น. |
| รับประทานอาหารกลางวัน               | เวลา 12.00 - 13.00 น. |