

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ – БАЗОВЫЙ КУРС



Международная тренинговая компания «НОСК Training» предлагает новую программу обучения по курсу: «Управление рисками – базовый курс».

Описание курса:

Курс дает фундаментальные знания в области риск-менеджмента и знакомит слушателей с лучшими практиками управления рисками. Образовательная программа преследует две цели:

1. Ознакомление слушателей с практическими аспектами управления рисками.
2. Подготовка слушателей к сдаче экзамена на международный сертификат по управлению рисками – Associate PRM, учрежденный международной профессиональной ассоциацией риск-менеджеров (Professional Risk Managers' International Association).

Для кого будет полезен курс:

Курс будет полезен аналитикам по управлению рисками, лицам, которые регулярно взаимодействуют с риск-менеджерами, а также топ-менеджерам, которые хотят понять принципы управления рисками.

В процессе обучения слушатели:

- Получат знания о неколичественных методах управления рисками
- Получат представление о роли риск-менеджмента в функционировании коммерческих банков
- Получат знания о стандартах и лучших практиках управления рисками
- Освоят принципы управления процентным риском и его хеджирования
- Освоят принципы управления активами и пассивами
- Освоят принципы управления рыночными, операционными и кредитными рисками
- Научатся корректно измерять эффективность управления рисками
- Рассмотрят и обсудят практические примеры применения концепций управления рисками в банковской деятельности
- Получат необходимую подготовку для успешной сдачи экзамена на сертификат Associate PRM

Преподаватели курса:

Арсений Ульченков, FRM, MBA Wharton Business School, Пенсильвания, США.

Владимир Манаев, PRM, преподаватель ГУ-ВШЭ (Государственный университет - Высшая школа экономики), Москва, РФ.

Контакты:

Тел.: + 375 (17) 328 – 6116, + 375 (17) 226 – 0969

e-mail: edward.pilkevich@hocktraining.com

www.hocktraining.com



УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ – БАЗОВЫЙ КУРС

ПРОГРАММА КУРСА



Расписание курса:

- 5, 6 февраля 2010 (пятница, суббота)
- 12, 13 февраля 2010 (пятница, суббота)
- 19 февраля 2010 (пятница)
- 27 февраля 2010 (суббота)

Стоимость курса: 1 200 долларов США.

Занятие 1.

Преподаватель: Владимир Манаев.

1. Основные принципы управления рисками. Неколичественная теория риска и дохода.

- Определение финансового риска
- Роль риск-менеджера в финансовой компании
- Инструменты и стратегия управления рисками
- Виды рисков и их классификация
- Выбор между риском и доходностью
- Меры по внедрению системы управления финансовыми рисками
- Хеджирование
- Практический пример хеджирования
- Основы оценки опционов
- Диверсификация
- Доходность, скорректированная на риск
- CAPM
- Теорема Модильяни-Миллера

2. Роль стандартов в управлении рисками. Роль корпоративного управления в управлении рисками.

- Важность корпоративного управления в риск-менеджменте
- Роль совета директоров в управлении рисками
- Роль риск-директора в управлении рисками
- Типичная структура управления финансовыми рисками
- Роль внешних институтов (внешний аудит, регуляторы, рынок)
- Стандарты организации PRMIA
- Принципы корпоративного управления PRMIA
- Этические принципы PRMIA

Занятие 2.

Преподаватель: Владимир Манаев.

3. Управление кредитными рисками.

- Роль кредитного риск-менеджера
- Кредитный риск по ритейловым продуктам
- Скоринг
- Дефолт и вероятность дефолта
- Как секьюритизация передает риски
- Ценообразование на основе риска
- Кредитные рейтинги рейтинговых агентств
- Внутренние кредитные рейтинги
- Концепция потерь в случае дефолта (LGD)
- Кредитный риск на контрагента
- Модели кредитного риска
- Портфельный подход к управлению кредитным риском
- VaR оценка кредитного риска

Занятие 3.

Преподаватель: Арсений Ульченков.

4. Финансовые риски.

- Структура финансовых рынков
- Денежные рынки
- Рынок облигаций
- Рынок акций
- Валютный рынок
- Фьючерсный рынок
- Внебиржевые рынки
- Рынок товаров
- Энергетический рынок

5. Процентный риск и его хеджирование.

- Определение процентного риска
- Цена-доходность. Кривая доходности.
- Дюрация и другие меры чувствительности
- Форвардные и фьючерсные контракты
- Свопы
- Путы и коллы
- Кэпсы и флоры
- Свопционы, экзотические деривативы и финансовый инжиниринг
- Кредитные деривативы

Занятие 4.

Преподаватель: Арсений Ульченков.

6. Управление рыночными рисками. Управление активами и пассивами.

- Value-at-Risk основы
- Роль VaR в установлении лимитов на рыночный риск
- Подходы подсчета VaR
- Там, где VaR не работает. Реализация редких событий и стресс-тестирование
- Разработка сценариев стресс-тестирования
- Риск ликвидности
- Комитет по активам и пассивам
- Duration GAP, EaR
- Трансфертное ценообразование

Занятие 5.

Преподаватель: Владимир Манаев.

7. Управление операционными рисками.

- Подходы к управлению операционными рисками и их внедрение
- Как операционные риски связаны с другими типами рисков
- Ключевой риск-индикатор
- Ключевой риск-драйвер
- Простой сценарный подход количественного оценивания операционных рисков.
- Оценка операционных рисков по новым продуктам

8. Изучение case studies управления рисками. Изучение кейсов реализации кредитного и операционного риска.

Занятие 6.

Преподаватель: Арсений Ульченков.

9. Измерение работы подразделений.

- Концепция риск капитала и ее использование
- Регуляторный капитал
- RAROC
- Использование RAROC при принятии решений

10. Изучение case studies управления рисками. Изучение кейсов реализации рыночного, процентного и риска ликвидности.

За более подробной информацией обращайтесь:

Эдуард Пилькевич
Директор HOCK Training, Минск

+ 375 (17) 328 – 6116, + 375 (17) 226 – 0969
edward.pilkevich@hocktraining.com
www.hocktraining.com