
Программа: «Эффективное управление рисками»

11 – 13 июня, Анталия, Турция

Официальное приглашение

От лица компании GBS Group Ltd. приглашаем Вас и Ваших коллег принять участие для наработки новых профессиональных знаний и деловых контактов в специализированной программе по теме «Эффективное управление рисками», которая пройдет с 11 по 13 июня в Анталии, Турции.

План мероприятия

**В программу могут быть добавлены дополнительные темы и вопросы по Вашему запросу*

11 июня, среда: Первый день программы

- ❖ **Время занятий:** с 9:00 до 15:45
- ❖ **Перерывы:** 10:45–11:00 – кофе-брейк;
13:00–14:00 – обед.

Ключевые темы дня:**Тема 1: «Риски 2005-2030 годы. Тренды и прогнозы»**

- Общие горизонты рисков
- Тренды и влияние изменений рисков
- Требования регуляторов к рискам в Европе: текущие изменения

Тема 2: «Организация системы управления рисками: краткий обзор»**2.1 Примеры моделей и инструментов оценки рисков банков**

- **Кредитный риск:**
 - Рейтинговые модели;
 - PD, LGD и EAD;
 - Экспозиция к риску контрагента и CVA;
 - Ожидаемые кредитные убытки по МСФО 9.
- **Рыночные риски и риск ликвидности**
 - VaR (включая Stressed VaR, IRC);
 - Модели Expected Shortfall для определения ожидаемых входящих и исходящих денежных потоков.
- **Операционный риск**
 - Анализ распределения убытков (Loss Distribution Approach);
 - Интеграционные модели.
- **Комплаенс-риск**
 - Anti-Money Laundering (AML);
 - Anti-Fraud;

- Мониторинг трейдеров.
- **Управление капиталом**
 - Прогнозирование капитала;
 - Стресс-тестирование;
 - Эконометрические модели.
- **Поддержка принятия решений**
 - Кредитный андеррайтинг;
 - Коллекторские модели;
 - Модели на основе бизнес-линий (LOB models).
- **Оценка и ценообразование**
 - Оценка ценных бумаг без активного рынка;
 - Оценка деривативов;
 - Оценка структурированных продуктов;
 - Трансфертные цены.
- **Финансовый анализ**
 - Факторный анализ финансового результата (P&L Attribution);
 - Анализ денежных потоков;
 - Анализ коэффициентов и нормативов.
- **ESG**
 - риски, связанные с экологическими, социальными и управленческими аспектами, которые могут оказать влияние на финансовую стабильность компании.

2.2 Управление моделями рисков.

2.3 Данные для моделей.

❖ **15:45 - завершение первого дня, обсуждение вопросов участников.**

12 июня, четверг: Второй день программы

❖ **Время занятий:** с 9:00 до 15:45

❖ **Перерывы:** 10:45–11:00 – кофе-брейк;
13:00–14:00 – обед.

Ключевые темы дня:

Тема 3: «Оценка рисков по кредитным делам»

3.1 Оптимизация кредитного анализа и управление рисками:

- Основные компоненты скоринга: доходы, история, возраст, экономическая ситуация;
- Модели скоринга: классическая и современная;
- Процесс скоринга: сбор данных, обработка данных, принятие решений;
- Преимущества и примеры применения скоринга;
- Риски и ограничения применения скоринговой системы.

3.2 Роль ESG в кредитном процессе

- Сбор ESG информации о клиенте;
- ESG оценка: что это такое и как ее выполнить?
- Внутренний и внешний ESG рейтинг: особенности и различия;
- Управление рисками ESG в кредитном процессе;
- Методика оценки ESG рисков для клиентов;
- Влияние ESG оценки на процесс финансирования.

3.3 Финансовый анализ заемщика

- Практический кейс: Финансовый анализ корпоративных клиентов «Шоколадная фабрика».

В рамках кейса будут рассмотрены следующие элементы деятельности клиента: продажи, производительность и рентабельность, использование денежных потоков, способность погашения долга и структура финансов, прогнозы.

3.4 Мониторинг невозвратов кредитов

- Основные компоненты мониторинга: сбор, анализ, оценка;
- Классификация заемщиков и взаимодействие;
- Будущее мониторинга и влияние технологий.

❖ **15:45 - завершение второго дня, обсуждение вопросов участников.**

13 июня, пятница: Третий день программы

❖ **Время занятий:** с 9:00 до 15:45

❖ **Перерывы:** 10:45–11:00 – кофе-брейк;
13:00–14:00 – обед.

Ключевые темы дня:

Тема 4: «Операционные риски»

- Управление операционным риском: стратегия и модели;
- Модель Loss Distribution Approach;
- Симуляция методом Монте-Карло;
- Преимущества и ограничения Loss Distribution Approach;
- Интеграционные модели: вертикальные, горизонтальные, смешанные;
- Управление комплаенс риском: определение бенефициаров, критерии фиктивных операций;
- Требования к капиталу: операционный риск;
- Требования Базель 4: стандартный подход.

❖ **15:45 - завершение третьего дня, окончание и подведение итогов программы.
Вручение Дипломов.**

Диплом

По итогам программы участник получает Диплом международного образца.

Стоимость

Участие в академической части программы _____ **£ 2,150**

В данную стоимость включены: участие в программе, кофе-брейки, обеды, академические материалы, диплом участника.

Скидка: При регистрации от 3х участников стоимость на каждого составит _____ **£ 1,995**

Оплата может быть произведена в удобной для Вас валюте: Фунтах стерлингов, Евро и Долларах США.

Регистрация

По желанию участников в программу могут быть внесены дополнительные вопросы. Направьте свои пожелания и предложения вместе с регистрационной формой на электронный адрес: info@globalbs.co.uk.

Скачать форму регистрации на мероприятие Вы можете по следующей ссылке: <http://globalbs.co.uk/public/doc/GBS-Form.docx> или воспользуйтесь удобной формой регистрации на нашем сайте: <http://www.globalbs.co.uk/send-a-request>.



С уважением,
GBS Group Ltd.

Тел.: +44 2038 086679, +7 (499) 350-80-19

Email: info@globalbs.co.uk

eremeeva@globalbs.co.uk