



(495) 233-05-37

www.finofficer.ru

E-mail: office@finofficer.ru

**Семинар / Вебинар
Управление рисками в банке: банковский риск-менеджмент**

Программа

День первый.

1. Нормативное регулирование управления рисками в банковской сфере.

1. Сравнение требований Базель II и Базель III.
 - Обзор требований Банка России по вопросам управления рисками.
 - Компоненты системы управления рисками в банке на основе рекомендаций Базельского комитета, требований ЦБ РФ.

2. Управление рыночным риском в банке.

- Как формируется рыночный риск, особенности рисков отдельных видов активов.
- Трендовый анализ рыночных изменений, его использование в оценке рисков.
- Понимание вероятности, понятие распределение вероятностей, основные виды распределения вероятностей.
- Навыки анализа рыночного риска, понимание данных дисперсионного анализа.
- Концепция «шесть сигм».
- Навык расчета Value at Risk (VaR), понимание показателя VaR.
- Использование MS Excel для анализа рыночного риска: дисперсионные расчеты, расчеты плотности распределений, расчет VaR.
- Хеджирование рыночных рисков: рекомендации специалистов.
- Анализ эффективности хеджирования рыночного риска.

3. Риски деривативов.

- Понятие деривативов (производных ценных бумаг), виды деривативов, их характеристики.
- Связь деривативов с базовыми инструментами.

- Особенности рисков производных ценных бумаг: гамма-коэффициент, дельта коэффициент, вега-коэффициент, тета-коэффициент, ро-коэффициент, навыки понимания.
- Модель Блэка-Шоулза и ее использование в оценке рисков.
- Использование MS Excel для расчета по модели Блэка-Шоулза.

4. Кредитные риски банков.

- Факторы кредитного риска.
- Анализ корреляций при оценке кредитного риска.
- Признаки проблемной задолженности, расчет дефолта заемщика по Базельским требованиям и требования Банка России.
- Анализ качества обеспечения кредитов.
- Обзор требований по формированию обязательных нормативов банка.

День второй.

5. Риск потери ликвидности банком.

- Нормативы ликвидности банка.
- Анализ риска потери ликвидности в связи с разрывом в сроках погашения требований и обязательств.
- Основы сценарного моделирования при оценке рисков, стресс-тестирование.

6. Валютный риск в банке.

- Факторы, влияющие на валютный курс.
- Обзор методик прогнозирования валютных курсов.
- Использование различных инструментов хеджирования для управления валютным риском.
- Ограничения Базельского комитета и Банка России по валютным позициям банков.

7. Анализ рисков инвестиционных вложений.

- Факторы риска, влияющие на инвестиционный проект.
- Расчет эластичности в инвестиционном проекте.
- Анализ чувствительности инвестиционного проекта.
- Ситуационный анализ инвестиционного проекта.
- Качественное описание рисков инвестиционного проекта.
- Нивелирование рисков инвестиционного проекта.

Слушатели обеспечиваются учебным пособием и сборником нормативно-правовых документов.

Количество часов: 16 ак. часов

Место проведения: г. Москва, ул. Рабочая, д. 35 (м. Римская, м. Площадь Ильича)

Стоимость участия: 35300 руб. / 1 слушатель.

Постоянным слушателям – скидки.

При записи нескольких слушателей – скидки.

Ближайшая дата: По мере набора группы. Уточняйте информацию у менеджеров.