

Комплексная образовательная программа Стратегическое управление активами и пассивами

Совместная образовательная программа СберУниверситета и СРО
НФА при участии Банка России

2 STRATEGIC ALM ступень



Цели и структура программы

О программе:

Курс «Strategic ALM» — это вторая ступень комплексной программы, направленной на формирование целостного понимания стратегического управления балансом.

Для кого эта программа?

- Сотрудники и руководители казначейств финансовых организаций
- Члены комитета по управлению активами и пассивами банков и сотрудники, участвующие в принятии решений в области ALM
- Сотрудники корпоративных казначейств
- Сотрудники торговых подразделений
- Сотрудники некредитных финансовых организаций (страховые, НПФ, управляющие компании и другие)

Стратегическое управление активами и пассивами – единственная образовательная программа в России, созданная казначеями для казначеев

Акцент реализации программы: работа в мини-группах и «обучение через действие»

Уникальный преподавательский состав — руководители Казначейства Сбербанка

Три фокуса программы:

01

Понимание влияния основных операций Банка на реализацию балансовых рисков.

02

Применение финансовых инструментов для управления активами и пассивами Банка и создания стоимости.

03

Выбор оптимальных мер по управлению активами и пассивами на реальных банковских примерах.

Развиваемые компетенции:

- Риск-менеджмент
- Финансы
- Решение проблем / Системное мышление

Разработчики и преподаватели программы



АЛЕКСЕЙ ЛЯКИН

Вице-президент –
директор Казначейства
Сбербанка

Более 20 лет руководит ALM и казначейством в крупнейших банках страны — Сбербанк, ЮниКредит Банк. Руководит созданием системы эффективного управления активами и пассивами, ликвидностью и капиталом банка. Прошел кризисы 1994, 1998, 2008 и 2014 годов как директор казначейств. Является членом Совета директоров СРО НФА.



НИЯУ МИФИ (1990), МГУ
Эконом (1994)



МАКСИМ ВОРОБЬЕВ

Старший управляющий
директор Казначейства
Сбербанка

Имеет более 10 лет опыта работы в подразделениях ALM и Казначействах крупнейших банках страны - Сбербанк, ЮниКредитБанк, Московский Международный Банк. В настоящее время в качестве заместителя директора курирует стратегические инициативы и новые технологии в Казначействе ПАО Сбербанк



НГУ Мехмат (2004), РЭШ
МАЭ (2006), FRM, CFA,
Harvard Business School
(General Management
Program)



СЕРГЕЙ СИДЕЛЬНИКОВ

Старший управляющий
директор Казначейства
Сбербанка-начальник
управления процентного
и валютного рисков

Свою карьеру в Сбербанке Сергей начал в 2009 году. Основной фокус его работы — трансфертное ценообразование и управление балансом. В Казначействе занимается созданием и развитием системы управления процентным риском, управлением структурой баланса и бизнес-планированием. Первый в России certified asset liability manager (CALM).



НГУ (2007), РЭШ МАЭ
(2009), FRM, CFA, CALM

Структура программы

Самостоятельная работа, вебинар	Очный модуль	Самостоятельная работа, подготовка к зачету	Итоговый зачет
			
Дистанционно	Очно	Дистанционно	Дистанционно
22.02 – 28.02.2021	01.03 – 02.03.2021	03.03 – 27.09.2021	05.03 – 07.03.2021

Содержание очного модуля Strategic ALM

Деловой завтрак на одну из актуальных тем на рынке

Управление портфелем ценных бумаг

Влияние изменений в банковском регулировании и учете на подходы к управлению портфелем ценных бумаг. Лимиты и ограничения, установленные на портфели. Преимущества и недостатки различных стратегий управления. Практические примеры активных стратегий управления портфелем. KPI управляющего портфелем ликвидных активов.

Управление структурой продуктов физических и юридических лиц

Применение на практике принципов ценообразования по продуктам Банковской книги (концепция расчета некоторых компонент). Определение влияния эффекта каннибализации при запуске новых продуктов / изменении параметров действующих продуктов. Структурирование продуктов с учетом влияния процентного и валютного риска, риска ликвидности, достаточности капитала.

Организация ALM небанковских финансовых организаций

Определение группы и цели управления активами и пассивами Группы. Инструменты ALM в банковской группе. Задачи и особенности управления активами и пассивами в различных видах участников группы – банки, страховые компании, НПФ, нефинансовые компании

Моделирование и ML в Казначействе

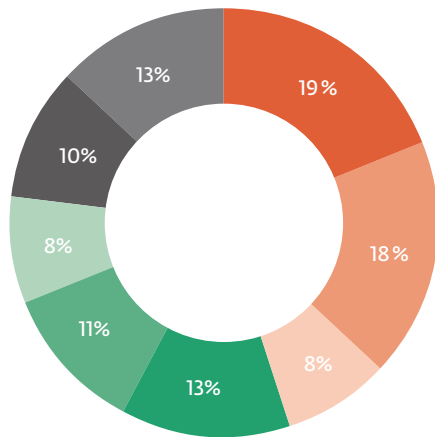
Принципы моделирования. Учёт поведения и рациональности клиентов. Моделирование эластичности. Технологии, и взаимодействие пользователей. Оптимизация структуры баланса. Использование моделей. Action plan: с чего начать.

Управление балансом

Управление балансом (комплексный подход к управлению активами и обязательствами компании или банковского учреждения). Работа ALM на примерах конкретных банков.

Интерактивная бизнес-игра по управлению балансом

Результаты программы в 2016–2020 годах



- Казначейство
- Корпоративный бизнес
- Розничный бизнес
- Риски
- Финансы
- IT
- Управление активами
- Другие

Приняли участие 590 слушателей:
9.5 — средняя оценка курса слушателями

« Это поистине уникальная программа. Такого не найдешь ни в одном учебнике. Что понравилось больше всего: групповой кейс по управлению балансом. Отлично разработанная модель на практике дает понять, как те или иные бизнес-решения оказывают влияние на разные риск-метрики банка.

Корпоративный бизнес

« Качество подготовки и подачи материала превзошло все ожидания. Особенно ценно, что теоретические основы тесно переплетались с практическими примерами. »

Риски

« Материалы несут высокую ценность для разработки ALM-политик ДЗО и разработки новых продуктовых решений с учетом модели работы Банка.

Управление активами

« Четко структурирован достаточно сложный материал, прекрасно подготовлены презентации и тестовое задание. Важно, что проделана большая работа. Включены как теоретические основы, так и конкретика, связанная с нашей непосредственной работой. Очень хороший уровень выступления всех лидеров. »

Финансы

« Хорошее содержание материалов, открытость обсуждения, практические кейсы и обмен опытом, погружение в тему, комплексный взгляд на процесс управления активами и пассивами. »

Казначейство Банка топ-10

Стоимость программы и регистрация

Стоимость программы Strategic ALM:

С проживанием	70 500
Без проживания	64 000

ВСЕ ЦЕНЫ УКАЗАНЫ В РУБЛЯХ И НА ОДНОГО СЛУШАТЕЛЯ

Регистрация на программу на сайте www.nfa.ru



Контакты

Михеева Ирина

Служба по организации мероприятий СРО НФА

+7 (495) 980-98-74 (122)

events@nfa.ru

СРО НФА. 107045, г. Москва, Большой Сергиевский переулок, 10



СБЕР УНИВЕРСИТЕТ – ЛУЧШИЙ КОРПОРАТИВНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ В РОССИИ И ТОП-3 В ЕВРОПЕ



Кампус

СберУниверситет спроектирован с учетом лучшего мирового опыта корпоративных учебных центров и органично вписан в уникальный природный ландшафт вдоль реки Истра.



Развитая спортивная и рекреационная **инфраструктура** мирового уровня позволяет дополнить бизнес-мероприятия активным и здоровым отдыхом.



Для проживания слушателей предусмотрен комфортабельный **гостиничный комплекс**.

