

Комплексная образовательная программа Стратегическое управление активами и пассивами

Совместная образовательная программа Корпоративного университета
Сбербанка и СРО НФА при участии Банка России

1

ALM&TREASURY
ADVANCED
LEVEL

2

STRATEGIC
ALM



СБЕРБАНК

Корпоративный
университет



Банк России



Совместная образовательная программа
Корпоративного университета Сбербанка и СРО НФА
при участии Банка России

КОМПЛЕКСНАЯ ПРОГРАММА СТРАТЕГИЧЕСКОЕ УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ И ПАССИВАМИ

Единственная в России



О ПРОГРАММЕ

«Стратегическое управление активами и пассивами» состоит из двух дополняющих друг друга курсов - Treasury&ALM.Advanced Level и Strategic ALM – направленных на формирование целостного понимания стратегического управления балансом.

Каждый курс включает в себя 2 дня очного модуля на базе Корпоративного университета Сбербанка с лекциями, семинарами, case-study и интерактивной групповой работой по управлению балансом банка.

Совместная образовательная программа Корпоративного университета Сбербанка и СРО НФА при участии Банка России.



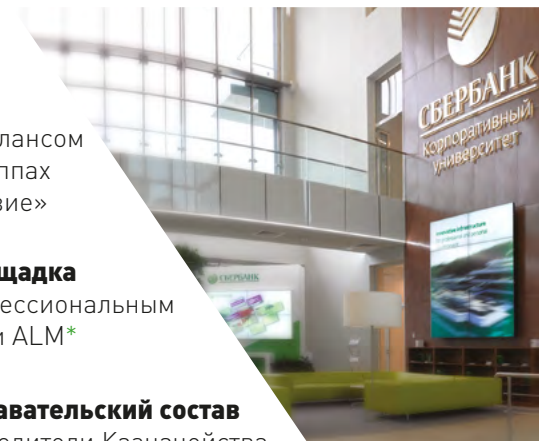
ДЛЯ КОГО ЭТА ПРОГРАММА?

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)



ПРЕИМУЩЕСТВА

- 1 Совместная программа**
СРО НФА и Корпоративного университета Сбербанка
- 2 Кейсы** по управлению балансом банка, работа в мини-группах и «обучение через действие»
- 3 Уникальная площадка** для обмена профессиональным опытом в области ALM*
- 4 Преподавательский состав** — руководители Казначейства Сбербанка с разносторонним опытом управления структурой баланса и рисками ALM
- 5 Обучение в кампусе** Корпоративного университета Сбербанка
- 6 Авторские материалы** с описанием процессов и их применения на практике





РАЗРАБОТЧИКИ И ПРЕПОДАВАТЕЛИ ПРОГРАММЫ



АЛЕКСЕЙ ЮРЬЕВИЧ 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.



МАКСИМ ВЛАДИМИРОВИЧ ВОРОБЬЕВ

Старший управляющий
директор Казначейства
Сбербанка

Работает в банковской
системе с 2005 года
в казначействах
крупнейших банков
страны и имеет
уникальный
опыт управления
ликвидностью
и капиталом
банка.
Курирует в Казначействе
Сбербанка направления:
ликвидность, капитал
и привлечение с рынков
капитала.



СЕРГЕЙ СЕРГЕЕВИЧ СИДЕЛЬНИКОВ

Управляющий
директор-начальник
управления структуры
баланса

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].



НА ОСНОВЕ ПРОГРАММЫ ИЗДАНА КНИГА «УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ALM И ЛИКВИДНОСТИ БАНКА»

Все слушатели программы получают книгу
«Управление рисками ALM
и ликвидности банка»
в подарок.



КЛЮЧЕВАЯ ЦЕННОСТЬ: КЕЙС ПО УПРАВЛЕНИЮ БАЛАНСОМ БАНКА

В рамках очного учебного модуля используется интерактивная модель по управлению балансом банка, которая усложняется с каждой пройденной темой

Данная модель учитывает сложные взаимосвязи между основными видами риска и различными направлениями бизнеса банка

На основе модели разработан кейс по управлению структурой баланса с учетом всех балансовых рисков



НИУ МИФИ (1990),
МГУ Эконом (1994)



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



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



Программа «ALM&TREASURY. ADVANCED LEVEL»

14.08.2020	Окончание регистрации
20.08.2020	Направление приглашений на программу
31.08 – 07.09.2020	Дистанционный модуль
08.09 – 09.09.2020	Очный модуль



Программа «STRATEGIC ALM»

28.01.2021	Окончание регистрации
01.02.2021	Направление приглашений на программу
18.02 – 28.02.2021	Дистанционный модуль
01.03 – 02.03.2021	Очный модуль



СОДЕРЖАНИЕ ОЧНОГО МОДУЛЯ

День 1 (8 сентября)

Введение в управление активами и пассивами
Денежно-кредитная политика Банка России и управление ликвидностью банковского сектора
Актуальные тенденции на внутреннем денежном рынке
Риск ликвидности Advanved level
Валютный риск банковской книги

День 2 (9 сентября)

Управление капиталом
Процентный риск банковской книги: продвинутые метрики и управление
Система трансфертного ценообразования, различные варианты реализации
Продвинутый кейс по управлению ALM



СОДЕРЖАНИЕ ОЧНОГО МОДУЛЯ

День 1 (1 марта)

Деловой завтрак
Управление структурой продуктов физических и юридических лиц
Управление портфелем ценных бумаг
Подходы к управлению активами и пассивами в банковской группе и отдельных ее участниках

День 2 (2 марта)

Управление балансом
Интерактивная бизнес-игра по управлению балансом
Моделирование баланса, дохода и метрик риска с учетом поведения клиентов



СОДЕРЖАНИЕ ПРОГРАММЫ

ПРОЦЕНТНЫЙ РИСК

Определение и цели управления процентным риском банка.

Основы измерения процентного риска и стресс-тестирования.

Управление процентным риском: лимиты, инструменты управления и хеджирование.

Управление риском встроенной опциональности.

Расчет метрик процентного риска (процентный гэп, экономический капитал, чувствительность чистого процентного дохода (далее — ЧПД)).

УПРАВЛЕНИЕ КАПИТАЛОМ

Определение и цель контроля достаточности капитала.

Показатели достаточности капитала, применяемые банком, методология их расчета.

Процесс управления достаточностью капитала.

Основные направления развития процесса управления достаточностью капитала.

ВАЛЮТНЫЙ РИСК

Определение и цели управления валютным риском банка.

Регуляторная и экономическая открытая валютная позиция (далее — ОВП).

Влияние основных банковских продуктов на ОВП.

Основы управления валютным риском: лимиты, инструменты управления.

Нелинейные эффекты валютного риска инструментов банковской книги.

Влияние валютной переоценки на различные статьи отчета о прибылях и убытках.

РИСК ЛИКВИДНОСТИ

Определение риска ликвидности, Базельское регулирование в части риска ликвидности.

Основные участники банковской системы (далее — БС), ликвидность БС и факторы, определяющие ликвидность БС.

Концепция управления риском ликвидности в банке.

Методы оценки и инструменты управления риском ликвидности в нормальных условиях ведения бизнеса и в стрессе.

Основные метрики ликвидности.

ТРАНСФЕРТНОЕ ЦЕНООБРАЗОВАНИЕ

Цели и задачи, концепция и основные принципы внутреннего фондирования и трансфертного ценообразования (иначе, FTP – funds transfer pricing).

Подходы к расчету стоимости фондирования по продукту.

Основные принципы ценообразования по продуктам.

Источники ЧПД банка.

Цель выделения и компоненты результата Внутреннего банка.

Декомпозиция ЧПД банка по видам риска.

УПРАВЛЕНИЕ СТРУКТУРОЙ ПРОДУКТОВ

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.

УПРАВЛЕНИЕ БАЛАНСОМ

Управление балансом (комплексный подход к управлению активами и обязательствами компании или банковского учреждения).

Работа ALM на примерах конкретных банков.

Создание стоимости банка через управление структурой баланса.

Интегрированный взгляд на риски и доходность банка.

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.

МОДЕЛИРОВАНИЕ БАЛАНСА И ПОВЕДЕНИЯ КЛИЕНТОВ

Принципы моделирования. Учёт поведения и рациональности клиентов.

Моделирование эластичности.

Технологии, и взаимодействие пользователей.

Оптимизация структуры баланса.

Использование моделей.

Action plan: с чего начать.





Комплексная программа Стратегического управления активами и пассивами



Корпоративный университет Сбербанка



В 2016-2019 ГОДАХ ПРОВЕДЕНЫ ПОТОКИ
ДЛЯ ПРЕДСТАВИТЕЛЕЙ БАНКОВ СНГ
И СОТРУДНИКОВ ГРУППЫ ПАО СБЕРБАНК

ПРОВЕДЕНО

12

потоков для
сотрудников
группы
ПАО Сбербанк



4

потока
для
банковской
системы

ПРИНЯЛИ УЧАСТИЕ

550

человек



средняя
оценка
программы
слушателями



9,5

из 10 баллов



ОТЗЫВЫ СЛУШАТЕЛЕЙ

«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 Д30 и разработки новых продуктовых решений с учетом модели работы Сбербанка.»

Управление активами

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

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



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



Кампус

Корпоративного университета Сбербанка 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**.





СТОИМОСТЬ УЧАСТИЯ В КОМПЛЕКСНОЙ ПРОГРАММЕ «СТРАТЕГИЧЕСКОЕ УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ И ПАССИВАМИ»

ALM&Treasury. Advanced Level

С конференц-пакетом	62 000
Без конференц-пакета	55 500

Strategic ALM 2021

С конференц-пакетом	70 500
Без конференц-пакета	64 000

ПАКЕТ: ALM&Treasury. Advanced Level + Strategic ALM 2021

С конференц-пакетом	125 000
Без конференц-пакета	110 000

ВСЕ ЦЕНЫ УКАЗАНЫ В РУБЛЯХ И НА ОДНОГО СЛУШАТЕЛЯ



РЕГИСТРАЦИЯ И ИНФОРМАЦИЯ

На сайте www.nfa.ru



ALM&Treasury.
Advanced Level



Strategic ALM
2021

Горькина Ольга

Руководитель Службы по организации мероприятий СРО НФА

+7 (495) 980-98-74

gob@nfa.ru

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



О Национальной финансовой ассоциации

Саморегулируемая организация «Национальная финансовая ассоциация» (СРО НФА) является ведущим профессиональным объединением участников российского финансового рынка, учрежденным в январе 1996 года крупнейшими российскими банками и инвестиционными компаниями рынка государственных ценных бумаг при поддержке Минфина РФ и Банка России.

В настоящее время в СРО НФА входит более 250 организаций – профессиональных участников из 27 регионов всех 8 федеральных округов страны, операции которых составляют примерно 80% объема российского рынка.

СРО НФА работает с Банком России как мегарегулятором и имеет статус саморегулируемой организации в отношении 6 видов профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и деятельности спецдепозитариев из 7 существующих на финансовом рынке лицензируемых видов профессиональной деятельности, эффективно выполняя установленные для СРО функции.



НАЦИОНАЛЬНАЯ
ФИНАНСОВАЯ
АССОЦИАЦИЯ