

Программа вебинара по теме:
«Управление рисками ПУ РЦБ: мировой опыт и лучшие практики.
Особенности организации СУР с учетом последних требований Банка России»

1. Введение

- 1.1. Среда: особенности макроэкономики и законодательные требования.
- 1.2. Возможная классификация рисков типичного российского участника финансового рынка.
- 1.3. История и мировой опыт. Международные стандарты управления риском.
- 1.4. Цели, задачи, принципы и концептуальные основы управления рисками.
- 1.5. Предпосылки и естественные конфликты внедрения СУР.
- 1.6. Основные методы и инструменты управления рисками.

2. Особенности требований Банка России по управлению рисками ПУРЦБ (с учетом изменения оргструктуры Банка России в 2020 г.).

- 2.1. Отраслевая специфика.
- 2.2. Карта требований Банка России к СУР в зависимости от профиля деятельности.

3. Требования к СУР в рамках Указания Банка России № 4501-У.

- 3.1. Естественные различия требований к брокерам, дилерам, доверительным управляющим и к компаниям инфраструктуры рынка ценных бумаг
- 3.2. История трансформации требований Банка России в рамках Указания Банка России № 4501-У в рамках перехода от проекта к нормативному акту.
- 3.3. Терминология и основные бизнес-процессы СУР.
- 3.4. Нюансы и подводные камни в Указании Банка России № 4501-У (регламент, значимые риски, совокупный риск, конфликт интересов, нормативные требования и др.).
- 3.5. Возможности и проблемы совмещения. Ограничения по аутсорсингу по СУР.

4. Финансовые риски. Методы управления типичными финансовыми рисками.

- 4.1. Типичные кредитные риски и методы управления ими.
- 4.2. Основные рыночные риски и методы управления ими.
- 4.3. Особенности оценки рисков ликвидности.
- 4.4. Возможная методологическая база ПУРЦБ по управлению финансовыми рисками.
- 4.5. Типичные ошибки управления финансовыми рисками.

5. Нефинансовые, в том числе, и операционные риски; принципы управления ими.

- 5.1. Инструментарий: Реестр рисков, База данных по рискам, План мероприятий по управлению риском, Отчет по рискам.
- 5.2. Методы выявления нефинансовых рисков.
- 5.3. Принципы целостности, непрерывности.
- 5.4. Непрерывность бизнеса организации и методы управления рисками непрерывности.
- 5.6. Возможная методологическая база ПУРЦБ по управлению нефинансовыми рисками.
- 5.7. Примеры отчетов по нефинансовым рискам.
- 5.8. Типичные ошибки управления нефинансовыми рисками.

Практических кейсы:

1. Возможная оценка кредитного риска портфеля инструментов с фиксированной доходностью.
2. Возможная оценка совокупного финансового риска инвестиционного портфеля.
3. Возможное построение совокупного риска ПУРЦБ в рамках требований Указания № 4501-У.
4. Подходы по отчетности в рамках требований Указания № 4501-У (Отчет по рискам, Отчет по эффективности, иные формы отчетности).