

ТОП

ОБУЧЕНИЕ В СРО НФА
Цикл Первый

ТРЕНИНГИ



СРО
НФА

ZEB
THE CONSULTANCY
FOR FINANCIAL
SERVICES



Сотрудники
1000+ Партнёры
60+ Консультанты
750+



Выпускники
6900

17 офисов
в 13 странах
Европы

Профессора
63



Уважаемые коллеги! **СРО НФА** совместно с нашим стратегическим партнёром **Zeb** – ведущей европейской компанией в области управленческого, стратегического и IT консалтинга для кредитных организаций, запускает цикл тренингов разного уровня сложности для топ-менеджмента и руководителей структурных подразделений банков.

Содержание и контент тренингов, глубина его проработки могут варьироваться от целей и потребностей банка, уровня и подготовки слушателей. Целевая аудитория предлагаемых тренингов – руководящий состав кредитных организаций.

Наше партнёрское предложение является эксклюзивным для своей экспертной и ценовой категории.

1

ИНТЕГРИРОВАННОЕ УПРАВЛЕНИЕ БАНКОМ.

В данном блоке детализировано будут освещены кросс-функциональные аспекты управления банком – от системы ключевых показателей эффективности и планирования до организационной структуры финансового института.

2

ФИНАНСЫ И КОНТРОЛЛИНГ

В этом блоке подробно рассматривается вариативность подходов к оценке и мониторингу финансовой эффективности банка, а также возможные методы её повышения.

ИНТЕГРИРОВАННОЕ УПРАВЛЕНИЕ БАНКОМ

ПРОДОЛЖИТЕЛЬНОСТЬ
КУРСА (ДНЕЙ)

3,5 ДНЯ

НАБОР
ГРУППЫ
ДО:

31
МАРТА

ДАТА
ПРОВЕДЕНИЯ
С:

22
АПРЕЛЯ

1 ВЛИЯНИЕ ГЛОБАЛЬНЫХ ФИНАНСОВЫХ КРИЗИСОВ НА БАНКОВСКИЙ СЕКТОР.

1. Значимость интегрированного управления банком в условиях снижения процентных ставок и ужесточения регуляторных требований:
 - Влияние финансовых кризисов на банковский сектор;
 - Регуляторные требования к учету и отчетности – влияние изменений принципов учета и новых требований на банковский сектор;
 - Влияние требований Базеля III на банковский сектор;
2. Критический взгляд на уровень доходности и капитализации европейских банков;
3. Актуальные тренды в банковском секторе:
 - Консолидация и «эффект масштаба»;
 - Повышение уровня специализации;
 - Стандартизация ИТ-систем и переход банков в разряд «поставщиков услуг»;
 - Развитие финансовых экосистем.

2 УПРАВЛЕНИЕ БАНКОМ, НАПРАВЛЕННОЕ НА СОЗДАНИЕ СТОИМОСТИ ДЛЯ АКЦИОНЕРОВ (VALUE-BASED MANAGEMENT):

1. Определение и задачи концепции VBM, сравнение с классическим подходом к управлению банком
2. Ключевые элементы концепции VBM:
 - Стратегия;
 - Управление ресурсами;
 - Основные управленческие процессы;
3. Создание выделенной функции VBM, ее роль и задачи в банке.

4 СИСТЕМА КПЭ И ДЕРЕВЬЯ ФАКТОРОВ СОЗДАНИЯ СТОИМОСТИ:

4. Взаимосвязь системы метрик для управления банком с концепцией VBM;
5. Классификация основных КПЭ (ключевых показателей эффективности) для управления банком;
6. Аллокация общепанковских КПЭ на уровни бизнес-подразделений – построение деревьев факторов создания стоимости;
7. Взаимосвязь КПЭ для управления банком с системой мотивации;
8. Система КПЭ и управленческая отчетность.

5 ИНТЕГРИРОВАННОЕ УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РЕСУРСАМИ (IFRM- INTEGRATED FINANCIAL RESOURCE MANAGEMENT):

1. Предпосылки и задачи интегрированного управления финансовыми ресурсами в банке
2. Основные элементы концепции IFRM:
 - Организация;
 - Методы;
 - Процессы;
 - ИТ и данные.
3. Внедрение концепции IFRM и ключевые факторы успеха.

6 ПЛАНИРОВАНИЕ И СЦЕНАРНЫЙ АНАЛИЗ:

1. Значимость комплексного и эффективного процесса планирования;
2. Составляющие элементы стратегического планирования, связь с системой КПЭ;

3. Подходы к оперативному планированию и бюджетированию;
4. Методология сценарного анализа для поддержки планирования;
5. Требования к ИТ-инструменту для сценарного анализа.

7 УПРАВЛЕНИЕ КАПИТАЛОМ:

1. Составляющие элементы комплексного управления капиталом;
2. Аллокация капитала;
3. Виды капитала для аллокации:
 - Коэффициенты аллокации, минимальная доходность.
 - Методы аллокации.
4. Расчет объема капитала для аллокации;
5. Планирование и реаллокация капитала;
6. Поиск баланса между доходностью и риском через аллокацию капитала.

8 ФУНКЦИОНАЛ И ОРГАНИЗАЦИЯ ПОДРАЗДЕЛЕНИЙ ФИНАНСОВ, КАЗНАЧЕЙСТВА И УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ:

1. Функции и задачи подразделений финансов, казначейства и управления рисками;
2. Организационная структура подразделений финансов, казначейства и управления рисками: лучшая практика, плюсы и минусы различных организационных моделей;
3. Взаимодействие между подразделениями – интегрированная архитектура финансов и рисков.

ПО ИТОГАМ КУРСА:

CERTIFICATE

Certificate of
attendance



СЕРТИФИКАТ

Сертификат
удостоверяющий
прохождение
образовательной
программы

СРО
НФА

РЕГИСТРАЦИЯ



NFA.RU

Стоимость обучения

100 000 ₽

ФИНАНСЫ И КОНТРОЛЛИНГ

ПРОДОЛЖИТЕЛЬНОСТЬ
КУРСА (ДНЕЙ)

5 ДНЕЙ

НАБОР
ГРУППЫ
ДО:

13
МАЯ

ДАТА
ПРОВЕДЕНИЯ
С:

03
ИЮНЯ

1 ОБЗОР ФУНКЦИИ КОНТРОЛЛИНГА И ПРИМЕНЯЕМОЙ МЕТОДОЛОГИИ:

1. Цели и задачи функции финансового контроллинга;
2. Организация работы контроллинга, взаимодействие с другими подразделениями банка;
3. Понятие и виды центров ответственности;
4. Ключевые метрики (КПЭ), подходы к управлению финансовой эффективностью банка:
 - Показатели прибыльности банка.
 - Подходы прибыли за период и приведенной стоимости.
 - Дерево показателей прибыльности.
 - Структура (контрибуционной) маржи.
 - Куб прибыльности банка.
5. Обзор составляющих контрибуционной маржи.

2 КОНТРИБУЦИОННАЯ МАРЖА (СХЕМА ОПРЕДЕЛЕНИЯ ДОХОДНОСТИ) И МЕТОДИКА РАСЧЕТА ЕЁ СОСТАВЛЯЮЩИХ:

1. Объекты, для которых применяется расчет контрибуционной маржи (бизнес-подразделение, клиент, сделка, банковское отделение и др.);
2. Структура контрибуционной маржи и ее особенности для различных объектов;
3. Составляющие процентного дохода (маржа бизнеса, маржа казначейства) и их взаимосвязь с системой FTP;

4. Непроцентные доходы: комиссионные доходы для активных и пассивных продуктов и пр., торговые доходы и их аллокация;
5. Стоимость риска (для активных сделок): ожидаемые убытки по сделке, методики расчета стоимости риска, взаимосвязь резервов под кредитный риск и стоимости риска;
6. Прямые и накладные расходы: классификация, различия между прямыми и накладными расходами, центры ответственности и учет расходов, аллокация расходов, основы методики определения нормативных затрат на единицу продукта;
7. Стоимость капитала;
8. Примеры применения методологии контрибуционной маржи (доходность клиентов, отделений, доходность и ценообразование продуктов);
9. Интеграция контрибуционной маржи по сделкам в общий финансовый результат банка.

3 ОПРЕДЕЛЕНИЕ НОРМАТИВНОЙ СЕБЕСТОИМОСТИ ЕДИНИЦЫ ПРОДУКТА (STANDART UNIT COST):

1. Виды центров затрат и учет расходов по центрам ответственности;
2. Каскадирование расходов, особенности затрат на ИТ;
3. ABC классификация продуктов;
4. Описание процессов для целей определения себестоимости. Методы определения затрачиваемого времени;
5. Результат от производительности и его интерпретация.

4 УПРАВЛЕНЧЕСКАЯ ОТЧЕТНОСТЬ И ИНСТРУМЕНТЫ ЕЕ ПОСТРОЕНИЯ, УПРАВЛЕНИЕ ДАННЫМИ:

1. Структура и примеры управленческой отчетности для контроллинга;
2. Типичная архитектура решений по формированию отчетности, основные элементы;
3. Управление данными (Data governance);
4. Качество данных и управление качеством данных;
5. Современные технологии работы с данными (Big Data, Machine Learning), их применимость для целей контроллинга;

5 УПРАВЛЕНИЕ РАСХОДАМИ: ВИДЫ РАСХОДОВ, СИСТЕМА КПЭ, УЧЁТ И ОПТИМИЗАЦИЯ РАСХОДОВ:

1. Классификация расходов и специфика управления затратами в банке;
2. Организация функции контроля в системе управления затратами;
3. Управленческий учет расходов;
4. Учет расходов по центрам ответственности;
5. Определение нормативной себестоимости единицы продукта (Standard Unit Cost);
6. Способы и методы внутренней оптимизации затрат;
7. Практические примеры аутсорсинга в банковской сфере.

ПО ИТОГАМ КУРСА:

CERTIFICATE

Certificate of
attendance



СЕРТИФИКАТ

Сертификат
удостоверяющий
прохождение
образовательной
программы

СРО
НФА

РЕГИСТРАЦИЯ



NFA.RU

Стоимость обучения

80 000 Р



**МИХАЭЛЬ ЛИСТЕР
(MICHAEL LISTER)**

Директор и научный руководитель бизнес-школы
Zeb business school

Признанный эксперт в области банковского управления,
финансов и рисков.
Соавтор учебника по банковским финансам и рискам
«Ertragswertorientiertes Bankmanagement» (Банковский
менеджмент, ориентированный на доход)

ТРЕНЕРЫ



САБИНА КОФЛЕР

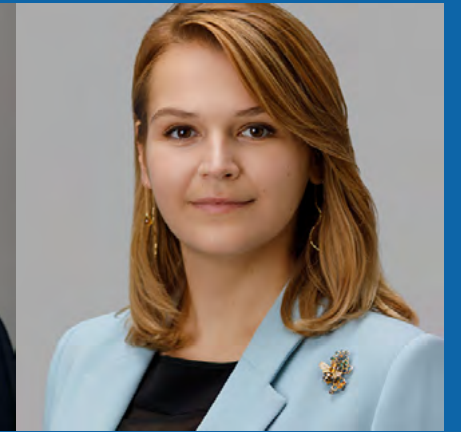
Проведение тренингов для
сотрудников Службы Анализа Рисков
и Банковского надзора ЦБ РФ по
подходам к оценке компонентов
кредитного риска на основе ПВР

Тренинги по практике ВПОДК для
регуляторов России и Австрии



МАКСИМ ЕГЕР

Проведение тренингов по
интегрированному риск-
менеджменту и банковскому
регулированию: методология,
методы расчета VaR, ВПОДК,
сценарный анализ, стресс-
тестирование



НАТАЛЬЯ ЛЫКОВА

Разработка тренингов по
интегральному стресс-
тестированию на основе ВПОДК

Разработка тренингов по расчету
кредитного риска на основе внутренних
рейтингов (ПВР)



АЛЕКСАНДР НЕФЕДОВ

Разработка тренингов по управлению
расходами в ведущем универсальном
банке Германии

Проведение семинаров по системам
управленческой отчетности для
русского банка



БОРИС ГРИНБЕРГ

Разработка и проведение
тренингов по организации функции
контроллинга в крупном банке
Германии

Тренинги по оптимизации расходов
и симуляции отчета о финансовых
результатах (P&L)



Д-Р ДИРК ХОЛЛЕНДЕР

Проведение семинаров для правления
топ-банков в России и Германии
по стратегической реорганизации,
интегрированному управлению
банком, стратегическому управлению
активами и пассивами



ТАРАС ТИЩЕНКО

Проведение воркшопов по
оптимизации расходов
в ведущих банках России

Тренинги по системам контроля
по защите данных в ведущем
австрийском банке



ШТЕФАН ТРЕМПЛЕР

Проведение тренингов для
сотрудников Службы Анализа
Рисков и Банковского надзора
ЦБ РФ по подходам к оценке
компонентов кредитного риска

Обзор практики моделирования
и валидации компонентов
кредитного риска



ИЛЬЯ АНТИПОВ

Проведение семинаров по системе
внутреннего трансфертного
ценообразования (FTP),
ценообразованию продуктов и
управлению структурой баланса для
ряда русских банков

РЕАЛИЗОВАННЫЕ ПРОЕКТЫ В СФЕРЕ ФИНАНСОВ, КАЗНАЧЕЙСТВА И УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

COMMERZBANK 

Разработка **концепции интегрированного управления финансовыми ресурсами и реорганизация подразделения финансов** с целью повышения эффективности



Разработка **концепции и проведение комплексного сценарного анализа, бизнеспланирования и поддержки принятия управленческих решений**

ТОП3¹
БАНК В РОССИИ

Разработка целевой системы **КПЭ, отчетности и принципов распределения финансового результата** для корпоративно-инвестиционного бизнеса

CREDIT SUISSE 

Разработка **целевой операционной модели для казначейства**, включая подходы к управлению капиталом, буфером ликвидности и открытой валютной позицией

Deutsche Bank 

Совершенствование **системы трансфертного ценообразования (ФТР)** для более точного моделирования денежных потоков и учета риска продуктов со встроенными опционами

ТОП3¹
БАНК В РОССИИ

Разработка **стратегии казначейства, концепции управления структурой баланса и подхода к распределению финансового результата** от процентного риска и риска ликвидности

UniCredit Bank 

Поддержка **внедрения показателя краткосрочной ликвидности (LCR)** в рамках требований Базель III, проведение гэп-анализа и разработка дорожной карты внедрения

Nordea 

Внедрение **требований Базельского комитета к предоставлению отчетности по рискам**, выявление несоответствий банка требованиям регулятора и их устранение

ТОП15¹
БАНК В РОССИИ

Разработка **концепции интегрального стресс-тестирования** в рамках требований Банка России к ВПОДК, создание и внедрение ИТ-инструмента стресс-тестирования

¹ - Название клиента не подлежит разглашению в целях сохранения конфиденциальности



РАБОТА С КРУПНЕЙШИМИ БАНКАМИ



СРО
НФА

Начальник Управления
по развитию проектных
инициатив

Вильям Грузинов

+7 (495) 980-98-74 (121)
gw@nfa.ru



Если данное приглашение не имеет отношения к сфере Вашей компетенции, пожалуйста, перешлите его Вашим коллегам, которые могут быть заинтересованы стать слушателями данных программ.

Спасибо!

