

KALENDÁŘ SEMINÁŘŮ na rok 2021

Advanced Risk Management, s. r. o.

CCR a CVA

3. února 2021

V úvodu semináře se účastníci seznámí s problematikou modelování a oceňování kreditního rizika, metodami měření a řízení kreditního rizika protistrany (CCR) a výpočtem výše budoucí expozice vůči protistraně. V další části semináře bude podrobně diskutován koncept Credit Valuation Adjustment (CVA), způsob jeho výpočtu a problémy spojené s realizací výpočtu v praxi. Během semináře budou účastníci seznámeni s měřením a řízením CCR a rizika CVA včetně výpočtu kapitálového požadavku.

Seminář je určen zejména specialistům bank a dalších kreditních institucí, kteří jsou odpovědní za řízení rizik a compliance. Dále je určen právníkům a interním auditorům.

ICAAP, ILAAP, pilíř 2 a stresové scénáře

16.–17. února 2021

Cílem teoretické části semináře je seznámit účastníky s problematikou ICAAP, metodami identifikace rizik, výpočtem ekonomického kapitálu, jeho agregací a alokací, a s využitím ekonomického kapitálu pro řízení bank. Seminář se dále věnuje způsobům stanovení interních kapitálových zdrojů a jejich plánování. Samostatná část semináře se zabývá stresovým testováním. Diskutována je i oblast ILAAP a související principy řízení rizika likvidity.

V praktické části semináře si představíme řízení kapitálu a měření výkonnosti banky z procesního pohledu – od vymezení odpovědnosti až po konečný reporting.

Seminář je určen především specialistům bank a dalších kreditních institucí, kteří jsou zodpovědní za implementaci Basel III v oblasti ICAAP, výpočet ekonomického kapitálu, interních kapitálových zdrojů a strategické plánování. Dále je určen interním auditorům.

Vymáhání v praxi (non-retail)

11. března 2021

Cílem semináře je seznámit účastníky s praktickými aspekty vymáhání úvěrových pohledávek ze segmentu non-retail. Proces vymáhání bude prezentován v kontextu měnícího se ekonomického a regulatorního prostředí.

Z pohledu věřitelské banky se účastníci seznámí s hlavními postupy vymáhání a jejich uplatněním v činnosti specializovaného útvaru Workout a dozví se, jak implementace standardu IFRS9 ovlivnila rozhodovací procesy ve věřitelské bance u tzv. nevykonných pohledávek. Součástí semináře je také představení nového doporučeného regulatorního rámce pro banky z autorské dílny ECB zahrnujícího komplexně celou oblast řízení a správy nevykonných pohledávek.

Seminář je určen především pro specialisty vymáhání bankovních úvěrových pohledávek v segmentu non-retail v útvech Workout a dále pro pracovníky oddělení EWS (Early Warning System), risk manažery, pracovníky obchodních úseků odpovědných za správu úvěrových pohledávek ve fázi pre-Workout (IFRS Stage 2), pracovníky útvarů Compliance a interního auditu.

Model Risk

15. března 2021

Množství a význam modelů používaných pro řízení finančních institucí neustále roste, a s tím roste i závažnost možných důsledků vyplývajících z jimi doporučených/automaticky realizovaných rozhodnutí.

Cílem semináře je proto naučit účastníky správně identifikovat a měřit rizika modelů a následně ukázat, jak výstupy těchto metod využívat pro praktické řízení rizika modelů. V rámci semináře budou diskutovány klíčové míry pro hodnocení správnosti a vhodnosti modelů, role validace, monitoringu, backtestingu a souvisejícího reportingu. Součástí semináře je i přehled regulatorních požadavků/očekávání v této oblasti. Pravidla řízení rizika modelů seminář představí na příkladech z praxe, a to během celého života modelu.

Seminář je určen pro všechny, kteří se zabývají řízením vývoje, implementací, validací a backtestingem modelů, a také pro risk manažery a interní auditory.

CRR 2/CRD 5

a další novinky bankovní regulace

16. března 2021 / 5. října 2021

Seminář poskytuje přehled o nejdůležitějších změnách v regulaci bank v oblasti řízení rizik. Účastníci se postupně seznámí s novinkami v regulaci za jednotlivá rizika – kreditní, operační a tržní riziko a riziko likvidity. Během semináře budou diskutovány novinky ve směrnících a nařízeních EU, ale i v upřesňujících textech orgánů EBA, BCBS či ECB. Část semináře je věnována rovněž novinkám v bankovním sektoru ČR/SR.

Cílem semináře je poskytnout účastníkům srozumitelné manažerské shrnutí širokého spektra revizí regulace z posledních let. Během semináře bude nastíněn i možný způsob implementace navrhovaných změn.

Seminář je určen pracovníkům risk managementu, compliance a interního auditu.

Controlling v praxi

13. dubna 2021

Seminář účastníky seznamuje se základními pravidly a postupy controllingu. Na praktických příkladech vysvětluje podstatu činnosti controllora a stěžejní pravidla tvorby controllingových zpráv a reportingu. Účastníci se dozví, jak zpětně hodnotit výkonnost instituce, základní pravidla nákladových kalkulací a controllingu projektů.

Seminář je určen pracovníkům controllingu a specialistům z finančních oddělení.

Riziko změn klimatu

14. dubna 2021

Seminář se zabývá problematikou rizika změn klimatu poctivým a k základům jdoucím způsobem: v první části semináře Vás seznámíme s fyzikální podstatou problému, v druhé s jeho rozměry a prokázanými a neprokázanými dopady. V poslední části si představíme možné způsoby reakce lidí, firem i států jak na problém klimatických změn jako takových, tak i na opatření přijatá nebo plánovaná proti tomuto jevu. V rámci semináře budeme prezentovat dostupná data, včetně diskuse chyb spojených s jejich získáváním.

Seminář je určen zejména pro střední a vyšší manažery, a to jak pro ty, kteří tuto problematiku považují za výmysl zelených aktivistů, tak i pro ty, kteří se naopak domnívají, že Země je již nenávratně zničena.

Kalendář seminářů na rok 2021

IRB v praxi

20. dubna 2021

Účastníci semináře se naučí, jak počítat kapitálový požadavek pro kreditní riziko IRB přístupem a jak zavést IRB přístup tak, aby byly splněny nejen kvantitativní, ale i kvalitativní požadavky na něj kladené. Jedním z hlavních diskutovaných témat je definice defaultu včetně stanovení materiality, rating a skóring klientů a také stanovení rizikových parametrů.

Seminář představí regulační požadavky pro oblast IRB – zejména EBA GL a ECB TRIM GL, které upřesňují požadavky v oblasti rizikových parametrů PD, LGD a CCF. Díky tomu, že je seminář založen na praktických zkušenostech získaných při zavádění IRB přístupu v bankách CEE regionu, budou diskutovány i praktické rady při implementaci jednotlivých požadavků.

Seminář je určen především risk manažerům a projektovým manažerům zodpovědným za implementaci IRB přístupu, pracovníkům interního auditu a compliance.

Bankovní regulace v kostce

18. května 2021

Cílem semináře je poskytnout účastníkům srozumitelnou formou komplexní přehled platné bankovní regulace. Na semináři budou prezentovány klíčové regulační požadavky, jako je výpočet kapitálových požadavků, stresové testování, rizikový apetit, ICAAP/ILAAP, a další vybrané oblasti bankovní regulace. Účastníci semináře se orientují v aktuální problematice a také se seznámí s předpokládaným budoucím vývojem bankovní regulace a vybranými aktuálními novinkami.

Seminář je určen pracovníkům útvarů řízení rizik, compliance, interního auditu a dalším specialistům, kteří pracují s bankovní regulací.

Green finance a ESG rizika

1. června 2021

Problematika tzv. zelených financí a ESG (environmentálních, sociálních a správních) rizik je jedním z aktuálních konceptů, který má potenciál významně ovlivnit fungování bank i jejich strategie.

Zejména požadavky na „zelené finance“ jsou vyžadovány jak částí veřejného mínění (zejména v bývalé tzv. „západní“ Evropě), tak i postupně se ustanovujícím systémem regulace. Jako ilustraci tohoto vývoje můžeme zmínit, že uvedená oblast tvoří jednu z celkem 6 priorit EBA pro rok 2021. Během semináře prozkoumáme jednotlivé aspekty tohoto problému a jejich dopady na banky a jejich klienty. Poslední část semináře je věnována rizikům sociálním a správním.

Seminář je určen zejména pro manažery a specialisty zodpovědné za řízení ESG rizik a compliance. Dále je určen interním auditorům.

Řízení kreditního rizika

9. září 2021

Seminář je zaměřen především na praktické aspekty řízení kreditního rizika. Úvodní část se stručně věnuje způsobům jeho identifikace a měření. Následně se seminář zabývá samotným řízením kreditního rizika, tzn. organizačním uspořádáním a nezbytnými procesními postupy včetně postupu vymáhání a následného reportingu.

Seminář je určen především pracovníkům oddělení financí a prodeje, v kreditních institucích pak risk managerům a expertům zodpovědným za kreditní riziko, dále interním auditorům a pracovníkům compliance. Seminář je rovněž určen specialistům pojišťoven, penzijních a investičních fondů, kteří se zabývají investicemi.

Operační riziko v praxi

14.–15. září 2021

První část semináře pokrývá otázky celkového rámce operačního rizika – jeho identifikaci, měření a řízení. Ve druhé části bude diskutována praktická implementace řízení operačního rizika s důrazem na hodnocení expozice vůči operačnímu riziku, rizikový apetit a klíčové rizikové indikátory (KRI). Dále budou diskutovány rozdíly v top-down a bottom-up přístupu při řízení operačního rizika, organizační uspořádání, tři linie obrany a role akčních plánů. Seminář také představí související témata, jako např. Business Continuity Management, operační riziko v IS/IT, reputační riziko a outsourcing.

Seminář je určen především risk manažerům a specialistům zodpovědným za operační riziko, interním auditorům a pracovníkům compliance.

Fraud Management v on-line světě

16. září 2021

Riziko podvodů je stále aktuální fenomén, který se díky automatizaci přenáší z fyzického do on-line světa. Seminář je zaměřen na prevenci a detekci podvodů, které se díky novým technologiím rychle mění. Na praktických příkladech uvidíte, jak předcházet sofistikovaným útokům a jak odhalovat podvodné scénáře v reálném čase.

Seminář je určen zejména risk manažerům, front manažerům, pracovníkům underwritingu a dalším účastníkům schvalovacího procesu z finančních i nefinančních institucí.

ERM aneb řízení rizik

na celopodnikové úrovni

19. října 2021

Cílem semináře je přiblížit problematiku nastavení jednotlivých procesů v systému řízení rizik. Během semináře budou diskutovány možné přístupy k identifikaci a měření rizik, postupy pro vytvoření katalogu rizik a jeho praktické využití. Dále bude diskutováno, jak katalog rizik využít při průběžném řízení společnosti a jak za tímto účelem nastavit interní reporting.

Seminář je určen zejména pro zaměstnance výrobních firem a firem z oblasti služeb.

Tržní riziko

2.–3. listopadu 2021

Seminář je zaměřen na všechny druhy tržního rizika (tj. pohyby kurzu cizích měn, úrokových sazeb, cen akcií a komodit). Účastníci se seznámí se širokou škálou metod pro měření a řízení tržních rizik, jako je např. otevřená pozice, gapová analýza, VaR, backtesting a stress testing. Součástí semináře je rovněž diskuse kvantitativních a kvalitativních požadavků na modely pro měření a řízení tržních rizik včetně praktických aspektů jejich implementace.

Seminář je určen specialistům středních a velkých firem, jejichž hospodaření je ovlivněno tržními riziky, a specialistům bank, pojišťoven, penzijních a investičních fondů, kteří se zabývají tržním rizikem a investicemi.