

## seminář

# ENTERPRISE RISK MANAGEMENT

## 24. října 2023

Business Park Košíře, Jinonická 80, Praha 5

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.

### CÍLOVÁ SKUPINA

Zaměstnanci výrobních firem a firem z oblasti služeb.

### PŘEDNÁŠEJÍCÍ

Mgr. Ing. Václav Novotný

ředitel, Advanced Risk Management, s.r.o.



Václav Novotný je ředitelem společnosti Advanced Risk Management, s.r.o. Více než 20 let se specializuje na poradenství a školení v oblasti identifikace, měření a řízení finančních rizik.

V roce 1994 započal svou kariéru v investičním oddělení České pojišťovny, a. s. Je zakládajícím členem a předsedou sdružení Risk Management Klub a často zvaným lektorem na konferencích a seminářích uznávaných institucí.

Václav Novotný vystudoval Matematicko-fyzikální fakultu Univerzity Karlovy a Fakultu financí a účetnictví Vysoké školy ekonomické v Praze. S oběma vysokými školami dlouhodobě spolupracuje jako externí lektor.

### TÉMATA SEMINÁŘE

Seminář se podrobně věnuje následujícím oblastem:

- > IDENTIFIKACE RIZIK A TVORBA KATALOGU RIZIK
- > ZPŮSOBY MĚŘENÍ RIZIK
- > PRINCIPY ŘÍZENÍ RIZIK
- > VZTAH COMPLIANCE A ŘÍZENÍ RIZIK
- > BUSINESS CONTINUITY MANAGEMENT (BCM)
- > COVID-19 A ERM
- > DODATEK: SPECIFIKA ŘÍZENÍ PROJEKTŮ A JEJICH RIZIK

# seminář ENTERPRISE RISK MANAGEMENT

## PRŮBĚH SEMINÁŘE

Seminář se koná od 9.00 do 17.00 (s přestávkami v 10.30, 12.30 a 15.15). Po skončení semináře následuje koktejl, na kterém je možné dále diskutovat.

## PROGRAM SEMINÁŘE

### ÚVOD

- Definice rizika
- Co to je ERM?
- Proč je třeba se ERM zabývat?
  - › Přínosy ERM
  - › Nebezpečí, když firma podcení ERM
- Proces řízení rizik:
  - › Ideální „technické“ předpoklady pro řízení rizik
  - › Identifikace rizik
  - › Měření rizik
  - › Řízení rizik
- Rizikový apetit a jeho vztah k řízení rizik
- Legislativa vztahující se k řízení rizik
- Použitá literatura
- Případová studie: Motivace zaměstnanců k řízení rizik**

### IDENTIFIKACE RIZIK A TVORBA KATALOGU RIZIK

- Katalog rizik a jeho úloha v rámci ERM
- Proces tvorby katalogu rizik:
  - › Expertní přístupy a RCSA
  - › Vztah FMEA a RCSA
  - › Externí data
- Koho do procesu zapojit a koho ne?
  - Případová studie: Proces tvorby katalogu rizik**
- Typická rizika a jejich definice

### ZPŮSOBY MĚŘENÍ RIZIK

- Co je to velikost rizika?
- Klasifikace přístupů k měření rizik
  - › Expertní přístupy a RCSA
    - Škály frekvence
    - Škály dopadu
    - **Případová studie: Využití metody RCSA**
    - Matice významnosti
  - › Maximální možná ztráta
  - › Stresové scénáře
  - › Statistické přístupy
  - › Koncept ekonomického kapitálu

### Zdroje dat

- › Interní vs. externí data
- › Analýza nastalých rizik

### Případová studie: Využití statistických metod

Relativní závažnost hlavních typů rizik pro firmy versus náklady / péče jim věnovaná

### Případová studie: Návrh škál frekvence a dopadu rizik

### Případová studie: 10 nejzávažnějších typů rizik

### PRINCIPY ŘÍZENÍ RIZIK

- Základní předpoklad – vhodná firemní kultura
- Klasifikace systémů řízení rizik
- Průběžné měření a monitoring
- Výstraha před blížícími se riziky - EWS a KRI
  - › **Případová studie: Návrh EWS**
- Nástroje na ovlivnění velikosti rizik:
  - › Klasifikace přístupů
  - › Prevence – snižování pravděpodobnosti výskytu rizik
  - › Příprava na rizikovou událost – snížení velikosti dopadu
  - › Přenos rizika na třetí stranu
- Organizace řízení rizik:
  - › Role majitele
  - › 3 linie obrany
  - › Role představenstva
  - › Role risk manažera
  - › Role compliance
  - › Role liniových manažerů
  - › Role interního auditu
- Vazba centrálního řízení rizik na systémy řízení dílčích rizik
- Pravidelný roční cyklus řízení rizik a jeho vazba na plánování
- Řízená diskuse: Proč je tak těžké zavést fungující systém řízení rizik?
- Efektivní interní reporting

### Případová studie: Návrh opatření ke snížení rizik

- Dodatek: ICT rizika
- Dodatek: Riziko outsourcingu
- Průmysl 4.0 – výzvy pro risk management
- ESG rizika a udržitelnost

### VZTAH COMPLIANCE A ŘÍZENÍ RIZIK

### BUSINESS CONTINUITY MANAGEMENT (BCM)

- Co to je BCM?
- Struktura BCM
- Identifikace klíčových procesů
- Identifikace krizových situací
- Business continuity plans (BCP) - příprava na krizové situace
- Aktualizace BCP
- Testování funkčnosti BCP
- DRM – disaster recovery management
- Případová studie: Návrh BCP**
- Případová studie: Deepwater Horizon**

### COVID-19 A ERM

### DODATEK: SPECIFIKA ŘÍZENÍ PROJEKTŮ A JEJICH RIZIK

- Co je projektové riziko?
- Nutné podmínky pro dobré řízení projektových rizik
- Identifikace projektových rizik
- Možnosti měření projektových rizik
- Možnosti ovlivňování (řízení) projektových rizik
- Kuchařka řízení projektových rizik
- Praktický návod jak pokazit každý projekt

### SHRNUTÍ SEMINÁŘE A ZÁVĚR

# seminář ENTERPRISE RISK MANAGEMENT

## REFERENCE

Allianz - Slovenská dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Air Bank a.s.

Artesa, spořitelni družstvo

Aviva životní pojišťovna, a.s.

BNP PARIBAS PERSONAL FINANCE SA, pobočka zahraniční banky

CENTRAL EUROPEAN ADVISORY GROUP

Čepro, a.s.

ČEPS, a.s.

Česká exportní banka, a.s.

Česká národní banka

Česká podnikatelská pojišťovna, a.s.

Česká spořitelna, a.s.

Česká spořitelna – penzijní společnost, a.s.

Českomoravská hypoteční banka, a.s.

Českomoravská stavební spořitelna, a.s.

Československá obchodní banka, a.s.

ČEZ, a.s.

Direct pojišťovna, a.s.

Dopravní podnik hl. m. Prahy, akciová společnost

E.ON Česká republika, s.r.o.

Equa bank a.s.

Erste & Steiermärkische Bank d.d.

Erste Asset Management GmbH, pobočka Česká republika

Exportní garanční a pojišťovací společnost, a.s.

Ezpada s.r.o.

Generali Česká pojišťovna a.s.

Hypoteční banka, a.s.

Komerční banka, a.s.

Kooperativa pojišťovna, a.s.

KPMG Česká republika, s.r.o.

ING Bank N.V.

Investiční kapitálová společnost KB, a.s.

J&T Banka, a.s.

KB Penzijní společnost, a.s.

Leasing České spořitelny, a.s.

Modrá pyramida stavební spořitelna, a.s.

Moneta Money Bank, a.s.

Moravia IT, a.s.

Národní banka Slovenska

Národní rozvojová banka, a.s.

NESS Czech s.r.o.

NET4GAS, s.r.o.

Nova KBM d.d.

OTP Banka Slovensko, a.s.

Penzijní fond České pojišťovny, a.s.

Pojišťovna České spořitelny, a.s.

Poštová banka, a.s.

PPF banka a.s.

Pražská energetika, a.s.

Pražská plynárenská, a.s.

Prima banka Slovensko, a.s.

Raiffeisen stavební spořitelna a.s.

Raiffeisenbank a.s.

Scania Finance Czech Republic, spol. s r.o.

SG Equipment Finance Czech Republic s.r.o.

SKB banka d.d. Ljubljana

Slovenská banková asociácia

Slovenská sporiteľňa, a.s.

Slovenský plynárenský priemysel, a.s.

Slovnaft, a.s.

STABILITA, d.d.s., a.s.

ŠkoFIN, s.r.o.

Tatra banka, a.s.

TRINITY BANK a.s.

UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.

Unipetrol, a.s.

Všeobecná úverová banka, a.s.

Zentiva, a.s.

Železničná spoločnosť Slovensko, a.s.

Věříme, že naše semináře budou, stejně jako minulým účastníkům, užitečné i vám.

## ORGANIZAČNÍ INFORMACE K SEMINÁŘI

**Přihlášení** Na seminář se můžete přihlásit na našich webových stránkách [www.arm.cz/prihlaska](http://www.arm.cz/prihlaska) nebo e-mailem na adresu [arm@arm.cz](mailto:arm@arm.cz). Přijetí přihlášky vám potvrdíme zasláním e-mailu.

**Poplatek** Účastnický poplatek za seminář činí 6 490 Kč + DPH. Poplatek za seminář zahrnuje kurzové, studijní materiály, kompletní celodenní občerstvení včetně obědů.

Po přihlášení bude vystavena zálohová faktura. Platba (provedena před termínem konání akce) je zálohou ve výši 100 % sjednaného poplatku. Daňový doklad obdrží účastník po zaplacení zálohové faktury nebo po skončení semináře poštou. Platby poukážte na účet společnosti Advanced Risk Management, s.r.o. číslo 13923349/0800 vedený u České spořitelny, a.s. na základě zaslání zálohové faktury.

**Storno podmínky** Účast na semináři lze zrušit pouze písemně. V případě odhlášení nejpozději 3 týdny před

zahájením akce bude účtován stornovací poplatek ve výši 10 % z uhrazené ceny. Při zrušení objednávky v době kratší než 3 týdny před zahájením akce je splatný celý účastnický poplatek bez náhrady. Organizace může vyslat na tento seminář jiného účastníka, než který byl původně přihlášen.


Advanced Risk Management, s.r.o. si vyhrazuje právo zrušit pořádání semináře a vrátit účastníkům zpět celou uhrazenou zálohu. Přihlašující organizace i účastník berou na vědomí, že svým přihlášením akceptují všechny výše uvedené podmínky.

**Ochrana osobních údajů** Advanced Risk Management, s.r.o. primárně pracuje s údaji, které jsou poskytnuty v rámci objednávky služeb. Jedná se zejména o následující údaje: e-mail, jméno a příjmení (případně akademický titul), kontaktní (doručovací a/nebo fakturační adresa), telefonní číslo a pracovní pozice.

Přehled základních zásad a principů ochrany osob-

ních údajů a dalších údajů zpracovaných společností Advanced Risk Management, s.r.o. naleznete na webové stránce společnosti [www.arm.cz](http://www.arm.cz) (Informace a přístup k osobním údajům).

**Ostatní ujednání** Advanced Risk Management, s.r.o. informuje účastníky, že na seminářích či jiných akcích pořizuje fotografie, které účastníky zachycují při účasti na seminářích a akcích. Společnost Advanced Risk Management, s.r.o. tyto fotografie poskytuje pouze ostatním účastníkům stejné akce, neposkytuje je třetím osobám a ani je nezveřejňuje. Účastníci mohou požádat, aby focení nebyli nebo aby jejich fotografie byly smazány a Advanced Risk Management, s.r.o. musí jejich požadavek dodržet.

 Chcete-li se během semináře zaměřit na vybrané téma nebo řešit v rámci případových studií konkrétní problém, napište nám prosím svůj návrh e-mailem na adresu [arm@arm.cz](mailto:arm@arm.cz).

## Advanced Risk Management, s.r.o.

Paříkova 3

190 00 Praha 9

t +420 257 290 252

e [arm@arm.cz](mailto:arm@arm.cz)

i [www.arm.cz](http://www.arm.cz)

IČO 26140403 • DIČ CZ26140403 • Městský soud v Praze, oddíl C, vložka 73787

