



Про серію семінарів

Ця серія семінарів є навчальною програмою у сфері управління ризиками для компаній з управління активами та адміністраторів пенсійних фондів. Першим у цій серії ми пропонуємо модуль, присвячений Операційним ризикам. Також планується навчання з кредитних та ринкових ризиків.

Метою серії є дати учасникам комплексне розуміння основних концепцій і процесів управління ризиками, заснованих на загальновизнаних стандартах управління фінансовими ризиками, також враховуючи особливості діяльності з управління активами та ініціативи регулятора щодо побудови системи ризик-орієнтованого нагляду за професійними учасниками фондового ринку.

Програми семінарів цієї серії засновані на МСФЗ 9 та на програмі Сертифікації в області ризиків, розробленої Глобальною Асоціацією Професіоналів Ризик Менеджменту (GARP, www.garp.org), по якій компанія Екстра Консалтинг є офіційним провайдером навчання.

Програми семінарів узгоджуються з УАІБ та наповнюються реальними практичними прикладами, що ілюструють застосування міжнародних інструментів управління ризиками. Це робить серію цих семінарів унікальним і цінним для тих, хто працює у сфері управління активами та хотів би підвищити свій професійний рівень з питань ризик-менеджменту.

Кому рекомендовано

- Керівники, менеджери і фахівці компаній з управління активами, які відповідають за ризик менеджмент.
- Керівники, менеджери і фахівці та адміністраторів пенсійних фондів.
- Члени Інвестиційних комітетів

Формат семінарів

Семінари будуть проходити в інтерактивній формі. Учасникам будуть запропоновані питання для колективного обговорення і обміну думками. Також у вигляді кейсів та практичних завдань будуть розглянуті та обговорені з учасниками реальні приклади реальних випадків з досвіду українських та іноземних фінансових установ.

Сертифікат

По закінченні кожного з семінарів учасники отримають Сертифікат про його проходження.



Модуль 1. Управління операційними ризиками КУА

ПРОГРАМА

27 вересня 2019 року

10:00 - 17:30

м. Київ, вул. Володимирська, 55 (Великий конференц-зал НАН України)

10:00 - 10:05 Вітальне слово: Анастасія Гаврилюк (УАІБ), Володимир Картавцев (Extra Consulting)

10:05 - 10:40 **Вступ:** коротко про систему управління ризиками (СУР) в організаційній структурі КУА (з урахуванням підготовки до запуску НКЦПФР системи нагляду на основі оцінки ризиків):

- a. Принципи та критерії вибору для прийняття рішення про призначення однієї відповідальної особи за управління ризиками в КУА чи підрозділу з РМ
- b. Формування організаційної структури управління ризиками КУА. Розподіл функцій та відповідальності ризик-менеджменту
- c. Порядок взаємодії ризик-менеджменту з іншими фахівцями/підрозділами КУА та звітування
- d. Регламентація питань етики (поведінки), управління конфліктом інтересів співробітників КУА

10:40 - 11:30 **Частина 1. Концепція, підходи та процес управління операційним ризиком**

- a. Регуляторні вимоги НКЦПФР та General Practice в управлінні операційним та комплаєнс-ризиком (Базель-2)
- b. Процес управління операційним ризиком:
 - i. Етапи процесу управління операційним ризиком: ідентифікація, оцінка, моніторинг, контроль та попередження ризиків
 - ii. Класифікація операційного ризику, застосовна до КУА
 - iii. Фактори та причини реалізації операційного ризику
- c. *Case-study. Аналіз кейсу операційного ризику, класифікація, ідентифікація причин, оцінка ризику*

11:30 - 13:00 Частина 2. Інструменти управління операційним ризиком

- a. Збір даних про події операційного ризику, аналіз бази інцидентів;
- b. Індикатори ризику та ефективності КУА (контроль зміни рівня ризиків)
- c. Опис внутрішніх процесів КУА, картографування операційних ризиків
- d. Сценарний аналіз та стрес-тестування;
- f. Case-study. Аналіз компанії/бізнес-процесу, практичне застосування інструментів управління операційним ризиком*

13:00 - 14:00 Обід

14:00 - 15:30 Частина 3. Специфічні типи операційного ризику

- a. Ризики зловживань та шахрайства (підробка документів, зловживання). Аналіз відомих кейсів з українського ринку
- b. Ризики інформаційної безпеки та безперервності діяльності. Політика інформаційної безпеки
- c. Регламентування розмежування доступів до інформаційних систем КУА, збереження електронних і паперових документів в діяльності КУА
- d. Case-study. Аналіз кейсу витоку інформації, визначення причин та наслідків реалізації ризику.*

15:30 - 16:00 Кава-брейк

16:00 - 17:00 Частина 4. Інструменти зниження, уникнення ризику. Ризик-орієнтований підхід в процесі прийняття управлінських рішень

- a. Звітність з операційного та комплаєнс-ризиків. Ризик-профіль
- b. Прийняття-пом'якшення-уникнення ризику – правильний вибір стратегії управління ризиком
- c. Ризик-орієнтований підхід. Коли ризикувати можна?

17:00 - 17:30 Підсумки семінару

Інструктор Модулю:



Олександр Мельников

Керівник управління операційними ризиками ПриватБанку.
12 років банківського досвіду у області управління операційними ризиками.
Відповідає за управління та оцінку операційного ризику, процес впровадження нових продуктів, внутрішній контроль, оцінку інформаційного ризику, запобігання шахрайству, планування безперервності бізнесу. Здійснення ідентифікації та оцінки операційного ризику, включаючи RCSA.
Стрес-тестування операційного ризику, оцінка сценаріїв у різних типах подій та щодо реалізації неочікуваних втрат.
Моделювання внутрішньої оцінки протидії шахрайству.