

Управление финансовыми рисками в условиях кризиса

Семинар ориентирован на менеджеров по управлению рисками в банках, страховых компаниях и компаниях реального сектора. Также семинар будет полезен представителям надзорных органов.

Цель семинара:

Ключ к успеху во время кризиса - принятие быстрых, квалифицированных решений. Поэтому в семинаре будут рассмотрены наиболее свежие рекомендации надзорных органов Великобритании, США, а также "кризисные" рекомендации Базельского комитета. Будут показаны стандартные "кризисные" меры управления кредитным и рыночным риском.

Программа:

1. Уроки кризиса. Кризис общепринятых подходов к управлению рисками.

Почему VaR недостаточно?

Как улучшить систему управления рисками?

Когерентные меры риска

Спектральные меры риска

2. Применение консервативных количественных методов оценки кредитного риска.

Методика анализа контрагентов и управление кредитным риском

Оценка кредитного риска в портфелях с низким количеством дефолтов

Управление риском концентрации в условиях кризиса

Математическое приложение: Новые подходы к интервальной оценке для биномиального распределения.

3. Стресс-тестирование в условиях кризиса.

Циклы ликвидности.

Анализ рекомендаций Базельского комитета (Январь, 2009).

Анализ рекомендаций FSA при проведении стресс-тестинга.

4. Управление рисками компаний реального сектора в условиях кризиса

Управление проектным риском в компаниях реального сектора с точки зрения ERM подхода

Управление рисками в проектном менеджменте

Выбор стратегии реагирования на риск в условиях кризиса

5. Управление рисками во время кризиса – рекомендации:

Анализ рекомендаций G-30 (Январь, 2009).

Анализ рекомендаций группы по надзору за финансовыми рынками при президенте США (Март, 2008).