



Управление риском ликвидности

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

ПРОДОЛЖИТЕЛЬНОСТЬ: 1 день (8 академических часов)

НАВЫКИ И УМЕНИЯ ПОСЛЕ ТРЕНИНГА:

- умение классифицировать риски ликвидности;
- навыки управления риском ликвидности.

ПРОГРАММА ТРЕНИНГА:

Тема 1. Риск ликвидности – основы.

- Природа и определение риска ликвидности
- Операции банка и их влияние на ликвидность
- Источники ликвидности банка

Тема 2. Классификация рисков ликвидности.

- Риск ликвидности баланса
- Риск ликвидности актива
- Спираль ликвидности

Тема 3. Управление риском ликвидности.

- Измерение риска ликвидности (NII, Gap, LaVaR, etc)
- Контроль риска ликвидности
- Управление ликвидностью в условиях кризиса

Case Studies: Orange County, Enron, LTCM.

Тема 4. Best Practice управления риском ликвидности.

- Директива FSA 09/16
- Рекомендации Базельского Комитета