

Управление операционными рисками

Семинар будет полезен менеджерам среднего и высшего звена, риск-менеджерам, специалистам по оптимизации бизнес-процессов, специалистам отдела внутреннего аудита. Семинар позволяет приобрести такие навыки и умения, как идентификация и моделирование операционных рисков, а также по стресс-тестированию.

ПРОДОЛЖИТЕЛЬНОСТЬ: 1 день (8 академических часов)

НАВЫКИ И УМЕНИЯ ПОСЛЕ ТРЕНИНГА:

- навыки моделирования операционных рисков с помощью базовых и продвинутых методов;
- навыки стресс-тестирования.

ПРОГРАММА ТРЕНИНГА:

1. Управление операционным риском – основы

- Определения операционного риска
- Идентификация операционных рисков
- Классификация операционных рисков – Базельский подход
- Неколичественные аспекты управления операционным риском

2. Модели оценки операционного риска

- Поход базового индикатора
- Стандартный подход
- Обзор продвинутых моделей оценки операционного риска
- Страхование в управлении операционным риском

3. Продвинутые модели оценки операционного риска

- Важность применения продвинутых моделей
- Loss Distribution Approach
- Internal Measurement Approach
- Потенциал применения Extreme Value Theory к оценке операционного риска

4. Стресс-тестирование операционных рисков

- Стресс-тестирование в условиях кризиса – анализ рекомендаций Базельского комитета (2009)
- Reverse stress-test (рекомендации FSA)
- Сценарный анализ операционных рисков
- Подсчет Operational Value-at-Risk