

ОНЛАЙН КОНФЕРЕНЦИЯ

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В БАНКОВСКОМ СЕКТОРЕ

23-24 июля 2020 года

Докладчики:

АЛЬФА-БАНК

БАНК ВТБ

РОССЕЛЬХОЗБАНК

РОСБАНК

ПРОМСВЯЗЬБАНК

БАНК РОССИИ

БАНК БКФ

БАНК САНКТ-ПЕТЕРБУРГ

БАНК РНКБ

СВЯЗЬ-БАНК

MUFG BANK (EURASIA)

ФОЛЬКСВАГЕН БАНК

БАНК КУБАНЬ-КРЕДИТ

НРД

БАНК БКС

SAS

- Калибровка и макро-моделирование кредитного риска в **Промсвязьбанке**
- Стресс-тестирование bottom-up в **банке ВТБ**
- Оптимизация и повышение эффективности работы системы по управлению операционными рисками в **Альфа-Банке**
- Процентный риск банковской книги: современная практика и новые регуляторные требования в **РНКБ банке**
- Особенности управления банковскими рисками в условиях цифровизации экономики в **банке БКС**
- План восстановления финансовой устойчивости для малых и средних банков в **Эм-Ю-Эф-Джи банке (Евразия)**
- Особенности управления модельным риском в **Росбанке**
- Управление нефинансовыми рисками в **SAS Россия**
- Фундаментальный пересмотр торговой книги: основные новации и основные сложности в **Россельхозбанке**
- Комплексное стресс-тестирование как инструмент оценки устойчивости банка в **РНКБ банке**
- Оценка эффективности реструктуризации задолженности **Фольксваген банк РУС**
- Особенности проведения интервью в рамках внедрения новых подходов к управлению операционным риском в банке **Кубань Кредит**
- Формирование и поддержание корпоративной риск-культуры в **НРД**

Время одного выступления докладчика 20-25 минут,
в конце доклада 5-10 минут на вопросы и ответы

Медиа Партнеры



По всем вопросам звоните + 7 495 649 84 14 или info@dialogmanag.com

10.30 Опыт организации удаленной работы службы риск-менеджмента

Петр Малинин, Руководитель направления нефинансовых рисков, и.о. директора Департамента Риск-менеджмента
Национальный расчетный депозитарий

Максим Осадчий, Начальник аналитического управления, Член Совета Банка
Банк БКФ

Динара Максумова, Директор по операционным рискам, Управление операционных рисков и контроля, Блок Риски
Промсвязьбанк

Алла Лиджиева, Директор дирекции банковских рисков
Банк Санкт-Петербург

- Планирование работы в новой реальности: чего начинается удалённая работа?
- Какие цифровые инструменты используются для удаленной работы
- Нюансы корпоративной коммуникации
- Сложные вопросы управления команды в режиме онлайн
- Как контролировать эффективность процессов и по какой методике оценить результат
- Формы отчётности

11.30 Основные риски банковского сектора России в 2020 году

Максим Осадчий, Начальник аналитического управления банка БКФ, Член Совета Банка
Банк БКФ

12.00 Перерыв на кофе

12.30 Стресс-тестирование bottom-up в России

Мария Кудрявцева, Советник Управления стресс-тестирования и моделирования процессов в банковском секторе
Банк России

- Стресс-тесты bottom-up в системе надзорного стресс-тестирования. Организация стресс-тестов bottom-up
- Основные составляющие комплексного динамического стресс-теста банка на уровне банковского сектора
- Данные и технологии современных банковских стресс-тестов

13.00 Стресс-тестирование bottom-up для банка-участника

Данил Трофимов, Заместитель руководителя Департамента интегрированного управления рисками, начальник управления консолидированного анализа рисков, вице-президент
Банк ВТБ

- Технологии стресс-тестирования в современном банке
- Основные составляющие комплексного динамического стресс-теста на уровне банка
- Стресс-тесты bottom-up в системе стресс-тестирования банковской группы

13.00 Калибровка и макро-моделирование кредитного риска. Внутренние vs внешние данные?

Михаил Помазанов, Руководитель подразделения валидации Блок "Риски"
Промсвязьбанк

- Эффективные методы калибровки внутренних рейтингов
- Преимущества и недостатки внутренних статистических данных по дефолтам
- Метод фильтрации данных Банка России для моделирования отраслево-ориентированной динамики вероятности дефолта
- Сопоставление результатов прямых и косвенных измерений частот дефолтов на рынке РФ
- Проблема учета отраслевой и целевой специфики кредитного портфеля

14.00 Перерыв на обед

15.00 **Операционные риски в период неопределенности**

Динара Максумова, Директор по операционным рискам, Управление операционных рисков и контроля, Блок Риски, **Промсвязьбанк**

15.30 **Оптимизация и повышение эффективности работы системы по управлению операционными рисками**

Александр Суровцев, Руководитель направления по операционным рискам

Альфа-Банк

- Организация системы по управлению операционными рисками
- Оценка эффективности системы по управлению рисками
- Мероприятия по повышению эффективности системы управления операционными рисками

16.00 **Процентный риск банковской книги: современная практика и новые регуляторные требования**

Ольга Степанова, Начальник управления рыночных, операционных рисков и ВПОДК, Департамент управления рисками

РНКБ Банк

- Современные подходы к оценке процентного риска банковской книги
- Внедрение стандартизованного подхода Базель III (BCBS 368)
- Практические аспекты управления процентным риском банковской книги в российских банках

16.30 **План восстановления финансовой устойчивости для малых и средних банков**

Максим Богач, Заместитель руководителя Службы управления рисками

Эм-Ю-Эф-Джи Банк (Евразия)

- Связь с ВПОДК
- Лучший международный опыт
- Области для улучшения

17.00 **Заключительное слово модератора и закрытие 1-го дня конференции**

10.30 **Практический опыт и особенности управления модельным риском в Росбанке**

Елизавета Розанова, Руководитель центра внедрения базельских рекомендаций управления рисками и математического моделирования

Росбанк

- Цикл управления модельным риском и его отличие от модельного цикла
- Ключевые роли процесса управления модельным риском
- Инструменты измерения модельного риска

11.00 **Управление нефинансовыми рисками**

Екатерина Юсупова, Директор департамента бизнес-консалтинга компании

SAS Россия

11.30 **Фундаментальный пересмотр торговой книги: основные новации и основные сложности**

Наталья Мартынова, Начальник отдела рыночных рисков

Россельхозбанк

12.00 **Перерыв на кофе**

12.30 **Комплексное стресс-тестирование как инструмент оценки устойчивости банка**

Ольга Степанова, Начальник управления рыночных, операционных рисков и ВПОДК, Департамент управления рисками
РНКБ Банк

- Основные методы проведения стресс-тестирования. Сравнительный анализ и области применения
- Цели стресс-тестирования как важный элемент построения модели. Оценка достижимости целей
- Методологические особенности проведения комплексного стресс-тестирования банка. Выявление слабых сторон классических моделей
- Оценка эффективности и условия, необходимые для успешного внедрения системы стресс-тестирования банка

13.00 **Оценка эффективности реструктуризации задолженности**

Константин Лосев, Head of Risk Methodology
Фольксваген Банк РУС

- Формы и элементы реструктуризации задолженности
- Подходы к оценке эффективности реструктуризации задолженности
- Оценка эффективности предоставления льготного периода в соответствии с Федеральным законом от 03.04.2020 №106-ФЗ

13.30 **Формирование и поддержание корпоративной риск-культуры**

Петр Малинин, Руководитель направления нефинансовых рисков, и.о. директора Департамента Риск-менеджмента
Национальный расчетный депозитарий

14.00 **Перерыв на обед**

15.00 **Особенности управления банковскими рисками в условиях цифровизации экономики**

Сергей Хайрулин, И.о. директора по рискам
Банк БКС

- Программа цифровой экономики: перспективы для банковской сферы
- Банки и Финтехи – кто кого?
- Цифровые банковские технологии – плюсы и минусы
- Новые акценты в управлении банковскими рисками

15.30 **Особенности проведения интервью в рамках внедрения новых подходов к управлению операционным риском в банке**

Александр Плотницын, Руководитель проекта
Банк Кубань Кредит

16.00 **Заключительное слово модератора и закрытие конференции**

Регистрационная форма участника

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В БАНКОВСКОМ СЕКТОРЕ



23-24 июля 2020 года

Стоимость участия в конференции в качестве слушателей:

Регистрация до 22.06.2020 г.	Регистрация после 22.06.2020 г.	Оплата после 24.07.2020 г.
28 000 руб.	33 000 руб.	38 000 руб.

ПРОСТЫЕ СПОСОБЫ РЕГИСТРАЦИИ



+7 495 649 84 14



info@dialogmanag.com



www.dialogmanag.com

ФИО

Должность

Руководитель

Компания

Телефон с кодом страны

Эл. Почта

Подпись

Дата

Компания Dialog Management оставляет за собой право изменить программу, слоты и докладчиков без предварительного уведомления.

**Время одного выступления докладчика 20-25 минут,
в конце доклада 5-10 минут на вопросы и ответы**