

Risikostyring og kontrol

Kursus i København

Dag 1	Dag 2
09.00 Velkomst og præsentation	09.00 Resumé
09.15 1. Risikostyring og kontrol <ul style="list-style-type: none">■ Hvorfor risikostyring?■ Typer af risici■ Udviklingstendenser indenfor risikostyring■ Hvad har man lært af finanskrisen?■ Opsætning og kontrol af limts■ Styring af modpartsrisiko■ Kapitalkravsdirektiver■ Basel III, Basel IV og Solvens II	09.30 3. Kreditrisiko <ul style="list-style-type: none">■ Hvad er kreditrisiko?■ Hvordan måles kreditrisiko?■ Kreditrisiko på derivater■ Kreditderivater■ BIS III, BIS IV og kreditrisiko
11.00 2. Måling og styring af markedsrisiko <ul style="list-style-type: none">■ Risiko på enkeltpositioner<ul style="list-style-type: none">○ Varighedsbegreberne○ Risiko på realkreditobligationer	12.00 Frokost
12.00 Frokost	13.00 4. Likviditetsrisikostyring <ul style="list-style-type: none">■ BIS anbefalinger■ Nye likviditetsratios■ GAP Analyse■ Stress Test og Contingency Funding Plan
13.00 2. Måling og styring af markedsrisiko, fortsat <ul style="list-style-type: none">○ Volatilitet og korrelation○ Beta-værdi○ Optioner■ Value at Risk (VaR)<ul style="list-style-type: none">○ Hvad er VaR?○ VaR for enkeltpositioner og porteføljer○ Stresstesting og Backtesting○ Historisk simulation	14.00 5. Operationel risiko <ul style="list-style-type: none">■ Hvad er operationel risiko?■ Anbefalinger omkring styring■ De forskellige tilgange til måling og styring
16.00 Slut dag 1	15.00 6. ESG-risiko og klimarisiko <ul style="list-style-type: none">■ Hvordan adskiller ESG-risiko sig fra andre risici?■ Udfordringer med ESG-risk management■ Klima-risiko<ul style="list-style-type: none">○ Transitionsrisiko○ Fysisk risiko■ Scenarier (Network for Greening the Financial Sector)■ Kreditrisiko som følge af klimaforandringer
	16.00 Afslutning og evaluering

Price

Prisen for kurset er DKK 13.500 ex moms. Prisen er inklusiv kursusmateriale og forplejning.

