

FÅS OGSÅ  
SOM ONLINE  
KURSUS

## Certificeret Risk Manager

10.-11. september

8.-9. oktober

7.-8. november

København  
2024

10% rabat ved tilmelding inden  
10. juli 2024.



**Financial**  
Training Partner A/S

# Praktisk information

## Hvem bør deltage?

Denne uddannelse er relevant for medarbejdere i den finansielle sektor, der ønsker en bred og dyb forståelse for de værktøjer, der anvendes til styring af risici. Du lærer hvordan man måler og styrer markedsrisiko, kreditrisiko, likviditetsrisiko og operationel risiko.

## Indhold

Uddannelsen indeholder tre moduler af i alt 6 dage. Mellem hvert modul vil du blive bedt om at læse relevant litteratur og løse nogle mindre opgaver. Du vil have mulighed for at tage en test efter det sidste modul for at blive Certificeret Risk Manager.

## Online kursus

Du kan også tage kurset som et online kursus. Dermed kan du selv vælge, hvornår du vil tage kurset og i hvilket tempo. Det er også muligt blot at tage enkelte moduler online.

Læs mere på [www.FinancialTP.dk/online-kurser](http://www.FinancialTP.dk/online-kurser)

”Super relevant og interessant. Flere ting jeg vil kunne anvende til daglig. God kombination af undervisning og opgaver.”

Kristian Dyhrberg, Lån & Spar  
Certificeret Risk Manager

”Meget dybdegående og samtidigt pædagogisk. Jørgen er god til at sætte materialet i perspektiv.”

Michael Ejlerskov, Aalborg Forsyning  
Certificeret Risk Manager

## Modul 1 – Markedsrisiko – måling og styring

10. september 2024

11. september 2024

### 1. Risici på enkeltinstrumenter

- Enterprise Risk Management
- Rentepositioner
- Aktierisiko
- Valutarisiko
- Risici på derivater

### 2. Volatilitet og korrelation

- Simple Moving Average
- Exponentially-weighted Moving Average
- GARCH-modeller
- Alternative investeringer

### 3. Value at Risk og Expected Shortfall

- Delta Normal VaR
- Historisk simulationsbaseret VaR
- Expected Shortfall
- Marginal, Component og Incremental VaR

### 3. Value at Risk, fortsat

### 4. Kapitalkrav til markedsrisiko, Back testing og fremtidig regulering

- Kapitalkrav
- Fundamental Review of the Trading Book
- Backtesting

### 5. Stresstesting

- Formål og metoder
- Erfaringer fra Subprime-krisen

# Modul 2 – Kreditrisiko – måling og styring

8. oktober 2024

9. oktober 2024

## 1. Introduktion til kreditrisikomåling og -styring

### 2. Centrale kreditparametre

- PD, EAD, LGD, konverteringsfaktor, recoveries og korrelationer
- Beregning og fortolkning

### 3. Kreditrisikomodeller

- KMV Moody's
- CreditMetricsTM
- Porteføjerisiko og marginal kreditrisiko

## 4. Modpartsrisiko på derivater

- Metoder til måling af modpartsrisiko
- CVA, DVA, FVA og BCVA
- Afdækning af modpartsrisiko

## 6. Kapitalkrav

- Standard-metoden eller IRB-metoden
- BIS IV

## 7. Credit Default Swaps

- Markedet og konventioner for CDS-kontrakter
- Afdækning med CDS-kontrakter

# Modul 3 – Operationel risiko og likviditetsrisiko

7. november 2024

8. november 2024

## Operational Risiko

### 1. Introduktion til styring af operational risiko

### 2. Måling og styring af operational risiko

- Heat Map
- Risk Control Self Assessment
- Opbygning af database

### 3. Klima og ESG-risiko

### 4. Kapitalkrav til operational risiko

- Basic Indicator-metoden, Standard-metoden og Advanced Measurement Approach
- Operationel risiko i forsikringsbranchen
- Fremtidige krav

## Likviditetsrisikostyring

### 1. Introduktion til likviditetsrisikostyring

### 2. Likviditetsnøgletal

- Liquidity Coverage Ratio
- Net Stable Funding Ratio

### 3. GAP-analyse

- Likviditetskurven
- Liquidity at Risk

### 4. Stresstesting og Contingency Funding Plan

- Markedslikviditetsrisiko
- Udarbejdelse af CFP

## Praktisk information

### Tid og sted

Uddannelsen består af tre moduler. Alle moduler afholdes i København. Undervisningstiden er fra kl. 9.00 til 16.00.

### Sprog

Undervisningen foregår på dansk.

### Tilmelding

Via [www.FinancialTP.dk](http://www.FinancialTP.dk)

### Pris

Prisen for uddannelsen er DKK 34.000 ex. moms. Prisen er inklusiv opgaver, eksamen, kursusmateriale, forplejning og diplom.

### Early Bird

Tilmeld dig uddannelsen inden 10. juli 2024 og få 10% rabat.

### Instruktør

#### Jørgen Just Andresen

Jørgen Just Andresen er adm. direktør i Financial Training Partner A/S, som han medstiftede i 2002.

Han har mange års undervisningserfaring som chefkonsulent i SimCorps kursusafdeling, hvor han startede i 1996. Før SimCorp arbejdede han i Danske Bank med salg og analyse af obligationer.

Jørgen har arbejdet i flere år som ekstern lektor på CBS (Copenhagen Business School), hvor han blev kåret som årets underviser på HD, Finansiell Rådgivning.

Han er forfatter til bøgerne Finansiell Risikostyring og Finansielle Derivater udgivet på DJØFs Forlag.

Han er uddannet cand.merc.int og HD(R).

## Financial Training Partner A/S

Financial Training Partner er førende Skandinavisk udbyder af finansiell uddannelse og har løst opgaver for samtlige større finansielle institutioner i Skandinavien.

Vi tilbyder åbne finansielle kurser, certificerende uddannelsesforløb, kundetilpassede firmakurser, konferencer og konsulenttydelser.

