WWW.FINANCIALTP.DK

Certificeret Risk Manager

15.-16. september
6.-7. oktober
3.-4. november

København
2026

Financial
Training Partner A/S

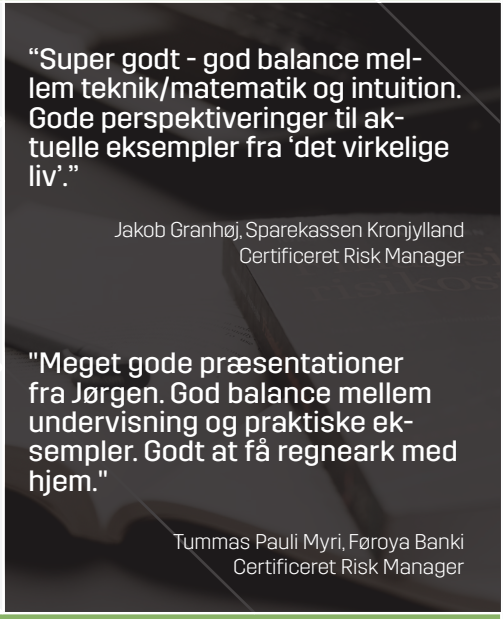
Praktisk information

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, klimarisiko, 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.

Uddannelse som e-learning
Du kan også tage uddannelsen som e-learning. Dermed kan du selv vælge, hvornår og i hvilket tempo du vil tage uddannelsen. Det er også muligt blot at tage enkelte moduler.

Læs mere på www.FinancialTP.dk/online-kurser



"Super godt - god balance mellem teknik/matematik og intuition. Gode perspektiveringer til aktuelle eksempler fra 'det virkelige liv'."

Jakob Granhøj, Sparekassen Kronjylland
Certificeret Risk Manager

"Meget gode præsentationer fra Jørgen. God balance mellem undervisning og praktiske eksempler. Godt at få regneark med hjem."

Tummas Pauli Myri, Føroya Banki
Certificeret Risk Manager

Modul 1 – Markedsrisiko – måling og styring

15. september 2026

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

16. september 2026

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

6. oktober 2026

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
- Porteføljerisiko og marginal kreditrisiko

7. oktober 2026

4. Modpartsrisiko på derivater
- Metoder til måling af modpartsrisiko
- CVA, DVA, FVA og BCVA
- Afdækning af modpartsrisko

6. Kapitalkrav
- Standard-metoden eller IRB-metoden
- Kapitalkrav til forsikring og pension

7. Credit Default Swaps
- Markedet og konventioner for CDS-kontrakter
- Afdækning med CDS-kontrakter

Modul 3 – Operationel risiko og likviditetsrisiko

3. november 2026

Operationel Risiko

1. Introduktion til styring af operational risiko

2. Måling og styring af operationel risiko
- Heat Map
- Risk Control Self Assessment
- Opbygning af database

3. Klima og ESG-risiko

4. Kapitalkrav til operationel risiko
- Kapitalkrav til kreditinstitutter
- Kapitalkrav til forsikring og pension

4. november 2026

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

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

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, Finansiel Rådgivning.

Han er forfatter til bøgerne Finansiel 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 finansiel uddannelse og har løst opgaver for samtlige større finansielle institutioner i Skandinavien.

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

Tlf. +45 70 23 23 10
info@FinancialTP.dk
www.FinancialTP.dk

Financial
Training Partner A/S