

Kreditrisiko - måling og styring

Kursus i København

Dag 1

09.00 Velkomst og Introduktion

09.15 1. Introduktion til kreditrisikomåling og -styring

- Overblik over typer af kreditrisici
- Tilgange til måling af kreditrisiko
- Kreditgivningsprocessen
- Anbefalinger omkring kreditrisikostyring

10.00 2. Centrale kreditparametre

- Probability of Default (PD)
- Exposure at Default (EAD)
- Loss Given Default (LGD) og Recoveries
- Korrelationer
- Løbetid (M)
- Beregning og fortolkning

11.00 3. Kreditrisikomodeller

- Specielle kendetegn ved kreditrisiko
- Anvendelse af kreditrisikomodeller
- Hvad skal en kreditrisikomodel kunne?
- KMV Moody's

12.00 Frokost

13.00 3. Kreditrisikomodeller, fortsat

- CreditMetrics
- CreditRisk+
- Kreditrisiko på porteføljeniveau
- Marginal risiko
- Fordele og ulemper ved de forskellige modeller
- Workshop - beregning af kreditrisiko ved brug af de forskellige modeller

16.00 Afslutning, dag 1

Dag 2

09.00 Resumé

09.30 4. Modpartsrisiko på derivater

- Hvordan adskiller modpartsrisiko sig fra traditionel kreditrisiko?
- Centrale modpartsrisikobegreber
- "Risk neutral" eller "real world" pricing
- Tilgange til måling af modpartsrisiko
 - Simpel, analytisk eller Monte Carlo Simulation
- Metoder til reduktion af modpartsrisiko og krav fra EMIR
- CVA, DVA, FVA og BCVA
 - Regnskabsmæssig eller regulatorisk brug
- Workshop - beregning og fortolkning af Potential Future Exposure og CVA

12.00 Frokost

13.00 5. Kapitalkrav til kreditrisiko

- Standardmetoden
- IRB-metoden
 - Foundation eller avanceret tilgang
- CVA-charge på derivater
- Workshop - beregning af kapitalkrav

15.00 6. Credit Default Swaps

- Oversigt over kreditderivater
- Markedet og konventionerne
- Anvendelse til risikoreduktion
- Prisfastsættelse
- Risici

16.00 Afslutning og evaluering

Pris

Prisen for kurset er DKK 13.500 ex moms. Prisen inkluderer kursusmateriale, frokost og forplejning.

