

Risikostyring og kontrol

Kursus i København

Dag 1

09.00 **Velkomst og præsentation**

09.15 **1. Risikostyring og kontrol**

- 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

11.00 **2. Måling og styring af markedsrisiko**

- Risiko på enkeltpositioner
 - Varighedsbegreberne
 - Deltavektorer
 - Risiko på realkreditobligationer

12.00 **Frokost**

13.00 **2. Måling og styring af markedsrisiko, fortsat**

- Volatilitet og korrelation
- Beta-værdi
- Optioner
- Value at Risk (VaR)
 - Hvad er VaR?
 - VaR for enkeltpositioner og porteføljer
 - Stresstesting og Backtesting
 - Historisk simulation
 - BIS og markeds risiko
 - FRTB

16.00 **Slut dag 1**

Dag 2

09.00 **Resumé**

09.30 **3. Kreditrisiko**

- Hvad er kreditrisiko?
- Hvordan måles kreditrisiko?
- Kreditrisiko på derivater
- Kreditderivater
- BIS III, BIS IV og kreditrisiko

12.00 **Frokost**

13.00 **4. Likviditetsrisikostyring**

- BIS anbefalinger
- Nye likviditetsratios
- GAP Analyse
- Stress Test og Contingency Funding Plan

14.00 **5. Operationel risiko**

- Hvad er operationel risiko?
- Anbefalinger omkring styring
- De forskellige tilgange til måling og styring

15.00 **6. Økonomisk kapital**

- Økonomisk kapital og regulatorisk kapital
- Hvordan måles det og hvad bruges det til?
- Risk Adjusted Return on Capital (RAROC)

16.00 **Afslutning og evaluering**

Price

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

