

Wsparcie udzielone przez Norwegię poprzez dofinansowanie
ze środków Norweskiego Mechanizmu Finansowego

Projekt PL0435 *Wzmocnienie zdolności administracyjnych i instytucjonalnych Urzędu Komisji Nadzoru Finansowego w zakresie prawidłowego wprowadzania w życie dorobku prawnego Wspólnoty w obszarze rynku finansowego*

Szkolenie – moduł IV

Ryzyko oraz zarządzanie ryzykiem.

28 lipca 2010, Warszawa

Szczegółowy program

Godzina	Prowadzący	Temat
9.00-10.30	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none"> • Przegląd najlepszych metod zarządzania ryzykiem <ul style="list-style-type: none"> ○ Przegląd kultury ryzyka ○ Zastosowanie modelu wewnętrznego do zarządzania ryzykiem ○ Przegląd metod zarządzania modelem ○ Zarządzanie ryzykiem, aktuariat i audyt wewnętrzny – przegląd • Przegląd ryzyk systemowych i związanych z niewypłacalnością rządów
10.30-10.45		Przerwa
10.45-12.15	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none"> • Związek pomiędzy apetytem na ryzyko, kapitałem, limitami tolerancji na ryzyko oraz wyceną produktów • Techniki ograniczania ryzyka <ul style="list-style-type: none"> ○ Ryzyko w grupach ubezpieczeniowych, instrumenty CRTI ○ Dywersyfikacja i koncentracja ryzyka. Pomiar dodatkowego ryzyka związanego z koncentracją ryzyka i pomiar efektu dywersyfikacji ryzyka ○ Optymalizacja reasekuracji: porównanie różnych strategii reasekuracyjnych przez zakład w celu optymalizacji alokacji kapitału
12.15-13.00		Lunch
13.00-15.00	Philipp Keller	<ul style="list-style-type: none"> • Techniki ograniczania ryzyka (c.d) <ul style="list-style-type: none"> ○ Sekurytyzacja i inne kapitałowe instrumenty absorpcji ryzyka ○ Hedging ○ Spółki specjalnego przeznaczenia (Special purpose vehicles) • Co może pójść nie tak w zarządzaniu ryzykiem
15.00-15.15		Przerwa
15.15-17.00	Konrad Szuster	<ul style="list-style-type: none"> • Techniki akceleracji modelowej: portfele replikujące, dopasowanie rozkładu • Przykład – Przykład portfela replikującego