

ОТ ТРЕБОВАНИЙ БАНКА РОССИИ К ВНЕДРЕНИЮ: СУР/ПДК ДЛЯ ПРОФУЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ И ДРУГИХ ЗАИНТЕРЕСОВАННЫХ АУДИТОРИЙ

БЕСПЛАТНЫЙ ПРАКТИЧЕСКИЙ
ВЕБИНАР ОТ АЛЕКСАНДРА
БАРАНОВА И СЕРГЕЯ ПИЩИКОВА

10 июля 2018 г., 10.00-19.00

Сайт вебинара <http://risk.rcb.ru>

[Записаться на вебинар](#)

[Анонс возможностей по
индивидуальному консалтингу](#)

ЭКСКЛЮЗИВ 4501-У и 4630-У

Первый вебинар в РФ по практическому внедрению практик управления рисками для профессиональных участников РЦБ с учетом новых требований, последних комментариев и уточнений от Банка России.

АКТУАЛЬНОСТЬ

- Исполнение требований Банка России: 4501-У (с 28.06.18) и 4630-У (с 31.05.18)
- От описания проблем к выработке решений для профучастников РЦБ*

ЗАДАЧА

Предложение практических решений в части внедрения/развития/актуализации СУР профессиональных участников РЦБ, с учетом текущих требований Банка России 4501-У, 4630-У и перспективе появления новых требований регулятора.

ЦЕЛЕВАЯ АУДИТОРИЯ

- Топ-менеджеры
- Сотрудники подразделений риск-менеджмента
- Контролеры и представители служб внутреннего аудита
- Контролеры и аудиторы со стороны бенефициаров
- **Брокеры и дилеры**
(Части I, II)
- **Доверительные управляющие**
(Части I, II, III)
- **Регистраторы**
(Часть I)
- **Управляющие компании**
(Часть III)
- **Спецдепозитарии**
(Часть I, добровольное использования требований 4501-У)

**Основная предпосылка при управлении рисками: каждая Компания существует, чтобы создавать стоимость для сторон, заинтересованных в ее деятельности. Все организации сталкиваются с неопределенностью, и задачей руководства является принятие решения об уровне неопределенности, с которым Компания готова смириться, стремясь увеличить стоимость для заинтересованных сторон.*

Управление рисками позволяет руководству Компании эффективно действовать в условиях неопределенности, и связанных с ней рисков, а также использовать возможности, увеличивая потенциал для роста стоимости компании. В современных условиях процесс управления рисками является необходимой составной частью процесса управления Компанией. Содержание компонент управления рисками определяется тем, как руководство управляет организацией.

[ВИДЕОАРХИВ ПРОШЕДШИХ СЕМИНАРОВ](#)

Программа вебинара

9.30-10.00

Регистрация/кофе

10.00-12.30

Часть I. СУР: от требований 4501-У к внедрению (особенности лицензионной деятельности и отраслевой принадлежности).

1. Существующая нормативная база, связанная с СУР профучастников РЦБ.
2. Существующие потребности в части удовлетворения требований 4501-У (минимальные требования Банка России).

3. Уровни зрелости СУР:

3.1. Минимальная достаточность к СУР ПУРЦБ: формальное соответствие текущим обязательствам ЦБ к СУР ПУРЦБ («Игра в догонялки»)

- *4501-У*
- *Принципы, инфраструктура, процессы*
- *Реестр рисков, Самооценка*
- *Регламент. Пакет документов подход к разработке документов. Примеры.*
- *Опыт внедрения, типичные ошибки, спорные моменты.*
- *Значимость рисков*

3.2. Продвинутая версия построения СУР ПУРЦБ: соответствие п. 3.1. + работа на опережение в рамках появления ожидаемых требований Банка России («В опережение требований ЦБ»)

- *4501-У, Непрерывность деятельности 28-МР, Информационная безопасность*
- *Принципы, инфраструктура, процессы*
- *Продвинутый реестр рисков, Самооценка*
- *Подходы к управлению кредитным риском.*
- *Подходы к управлению репутационным риском.*

3.3. Построение интегральной модели СУР ПУРЦБ: соответствие п.п. 3.1, 3.2 + дополнительные опции («Формирование будущего законодательного поля по СУР» с учетом имеющихся мировых и российских практик).

- *Внутренний контроль, построение матрицы Контролей и рисков*
- *Принципы, инфраструктура, процессы*
- *Подходы к управлению регуляторным риском*
- *Управление стратегическим риском*
- *Интегральный реестр рисков. Цепочки рисковых событий.*
- *Мотивация персонала в системе управления рисками и внутреннего контроля*

- *Использование ССП (системы стратегических показателей) в СУР*
- *Построение проекта внедрения интегральной СУР*

4. Отличие фрагментарного подхода от комплексного интегрального управления рисками.

5. Профучастник РЦБ: выстраивание работы с бизнес-процессами, корпоративная культура (работа с операционными рисками). Практические примеры выявления рисков. Пример реестра рисков.

6. О возможностях аутсорсинга СУР в рамках 4501-У.

12.30-13.00

Кофе-брейк

13.00-13.30

Анонс возможностей по индивидуальному консалтингу:

- Подготовка внутренней документации профессионального участника РЦБ по системе управления рисками (в рамках требований 4501-У и других нормативных актов Банка России).
- Аудит бизнес-процессов и методологические рекомендации по построению системы управления рисками профучастника РЦБ.
- Идентификация и оценка типичных, существенных и ключевых рисков профучастника РЦБ.
- Внедрение и автоматизация бизнес-процессов по управлению операционным рисками профучастника РЦБ.
- Внедрение и автоматизация бизнес-процесса по расчёту показателя достаточности капитала профучастника РЦБ (в рамках требований 4630-У).
- Методологические рекомендации по организации бизнес-процессов по непрерывности деятельности профучастника РЦБ.

13.30-16.00

Часть II. ПДК: от требований 4630-У к внедрению (требования Банка России для брокеров и перспективы расширения требований).

1. Кого затрагивают требования?

2. Существующие потребности в части удовлетворения требований 4630-У (помимо требований 4501-У) Минимальная достаточность: кто, что, как?

3. Цели внедрения проекта автоматизация расчета ПДК, три возможных цели:

3.1. Минимальная достаточность к СУР ПУРЦБ - формальное соответствие текущим обязательствам ЦБ к СУР ПУРЦБ («Игра в догонялки»)

3.2. Построение интегральной модели СУР ПУРЦБ: 3.1. + 3.2 + дополнительные опции («Формирование будущего законодательного поля по СУР» с учетом имеющихся мировых и российских практик)

4. Возможный вариант решения задачи на уровне необходимых бизнес-процессов ПУРЦБ для расчета ПДК (для каждой цели).

5. Вызовы для ПУРЦБ, которые могут последовать, или почему лучше опережать регулятора на шаг, а не «играть в догонялки».

6. Преимущества автоматизации бизнес-процесса при расчете ПДК ПУРЦБ.

7. О возможном подходе стресс-тестирования финансовых рисков, в том числе и на основе ПДК.

16.00-16.30

Кофе-брейк

16.30-19.00

Часть III. Стресс-тестирование инвестиционного портфеля

1. Основные виды финансовых рисков. Основные подходы к оценке кредитного, фондового и процентного рисков инвестиционного портфеля. Особенности учета валютного риска.

2. Риск-бюджет как возможный интегральный показатель оценки совокупного финансового риска инвестиционного портфеля. Особенности учета ликвидности финансовых инструментов.

3. Риск-бюджет как инструмент инвестиционного планирования в рамках ограниченного риск-аппетита.

4. Использование показателя риск-бюджета для стресс-тестирования.