

ОПЫТ ПЕРВЫХ ПРОВЕРОК СО СТОРОНЫ БАНКА РОССИИ

- РЕГИСТРАТОРОВ
- ДОВЕРИТЕЛЬНЫХ УПРАВЛЯЮЩИХ
- БРОКЕРОВ

ПО ИСПОЛНЕНИЮ **4501-У**: ПРОБЛЕМЫ И ПОДХОДЫ К РЕШЕНИЮ.

БОНУС: НЮАНСЫ РЕВОЛЮЦИОННЫХ ИЗМЕНЕНИЙ АТТЕСТАЦИОННЫХ ТРЕБОВАНИЙ К СПЕЦИАЛИСТАМ РЦБ И КОЛЛЕКТИВНЫХ ИНВЕСТИЦИЙ С 01.07.19.

ОБЪЯСНЯЕМ: КАК ИЗБЕЖАТЬ ПРОБЛЕМ ПРИ БУДУЩИХ ПРОВЕРКАХ БАНКА РОССИИ?

ПРАКТИЧЕСКИЙ ВЕБИНАР ОТ СЕРГЕЯ ПИЩИКОВА И АЛЕКСАНДРА БАРАНОВА

8 августа 2019 г., 11.00-18.30

Сайт вебинара <https://risk.rcb.ru>

Записаться на вебинар (задать вопросы, получить онлайн доступ, а также доступ к записи вебинара)

ЭКСКЛЮЗИВ 4501-У, 532-П, 28-МР

СОДЕРЖАНИЕ ВЕБИНАРА

1. Виды проверок и запросов на предоставление информации
2. Организация СУР
3. Кредитный риск. Где Ваши резервы?
4. Рыночный риск. Как Вы его учитываете?
5. Балансовый процентный риск
6. Финансовая устойчивость
7. Перспективы деятельности
8. Непрерывность деятельности, техническое и технологическое оснащение
9. **NEW!** Кадровая политика и изменения аттестационных требований

ЦЕЛЕВАЯ АУДИТОРИЯ

- Регистраторы
- Доверительные управляющие
- Брокеры
- Специализированные депозитарии*

* для Спецдепозитариев актуальны общие вопросы проверок и классификации

Программа вебинара

11.00-13.00

1. Виды проверок и запросов на предоставление информации.

- Дуализм подходов к управлению рисками: ЦБ РФ и МинФин (МСФО)
- Нормативная база проверок
- Запросы
- Проверки

2. Организация СУР

- Порядок актуализации нормативной базы. «Один раз в год» - это в какой?
- Нюансы определения значимости рисков (корректное исполнение п. 2.2.1 4501-У)
- Функции Совета Директоров (СД) в СУР профучастника:
 - Положения об органах управления
 - Протоколы заседаний за период
 - Подтверждение исполнения принятых решений
- Коммерческий и стратегический риск, сходства и различия
- Кастодиальный риск регистратора. Есть ли он?
- План мероприятий (глазами ЦБ) по снижению исключению рисков, отчет по плану мероприятий.
- Нарушение сроков отчетности – пустячок. А неприятно!

13.00-13.30

Перерыв

13.30-16.30

3. Кредитный риск. Где Ваши резервы?

- Депозиты в кредитных организациях, имеющих рейтинг
- Депозиты в кредитных организациях, не имеющих рейтинг
- Займы юридическим и физическим лицам
- Нерыночные процентные ставки, что с ними делать?
- Амортизация по эффективной процентной ставке
- Длинные кредитные требования (депозиты, займы и т.д.). Как рассчитать вероятность дефолта на большом периоде (более года)?
- Нюансы расчета ожидаемых кредитных убытков по дебиторской задолженности. На что обращают внимание в первую очередь?

- В чем опасность кредитования связанных заемщиков?

4. Рыночный риск. Как Вы его учитываете?

- Оценка риска по долевым инструментам (акциям)
- Оценка риска по долговым инструментам (облигация) в рынке
- Оценка риска по некотируемым долговым инструментам (в том числе, вложения в ООО)
- Стресс-тест брокера по ПФИ
- Особенности управления рисками при работе с клиентами с особым уровнем риска (КОУР)
- Стресс-тест брокера, осуществляющего брокерскую деятельность при совершении отдельных операций и сделок за счет клиентов (маржинальное кредитование)
- Валютный риск. Отрицательная переоценка. Как им управлять?

5. Балансовый процентный риск

- Что за новшество? 532-П, в примечании 52 - "Управление рисками" - 52.16 «Чувствительность капитала к допустимым изменениям в процентных ставках»

16.30-17.00

Перерыв

17.00-18.30

6. Финансовая устойчивость

- Уровни финансовой устойчивости
- Риск-аппетит
- Влияние реализации рисков на финансовый результат и капитал профучастника
- Нарушение регуляторного уровня собственных средств (СС), без нарушения СС

7. Перспективы деятельности

- ЦБ РФ интересуется не только регуляторная составляющая надзорных организаций, но и перспективы отрасли. Когда плохо «мало», а плохо «много»?

8. Непрерывность деятельности, техническое и технологическое оснащение

- Управление рисками нарушения непрерывности деятельности:
 - Антропогенными
 - Техническими (Технологическими)
 - Внешними. Чрезвычайные ситуации. Планы ОНиВД (28-МР).

9. **NEW!** Кадровая политика и изменения аттестационных требований

- Формат новых требований по профессиональному стандарту
- Ожидаемые сроки вступления в силу
- Потенциальные проблемы, которые появятся у лицензируемых участников финансового рынка