

12 февраля 2020 года

Семинар «Организация СУР и регуляторные требования по управлению рисками для УК ПИФ и НПФ».

Институт МФЦ приглашает Вас принять участие в семинаре **«Организация СУР и регуляторные требования по управлению рисками для УК ПИФ и НПФ»**. Семинар проводится с участием высококвалифицированного специалиста в области риск-менеджмента с большим практическим опытом. *Обучение пройдет в дневном формате (10:00-14:00 мск). Возможно участие онлайн.*

Семинар «Организация СУР и регуляторные требования по управлению рисками для УК ПИФ и НПФ» предназначен для управляющих компаний (имеющих лицензию по управлению активами ПИФ и НПФ), а также для «смежников» управляющих компаний, в первую очередь, для специализированных депозитариев.

Семинар ориентирован на специалистов по управлению рисками, а также актуален для руководителей службы внутреннего контроля управляющих компаний.

На семинаре будут рассмотрены следующие вопросы:

- подходы и лучшие практики управления рисками с учетом мирового опыта;
- регуляторные требования по управлению рисками управляющих компаний в России (учет требований Банка России и СРО управляющих компаний);
- нюансы связанные с профилем деятельности управляющей компании, в том числе и в контексте совмещения лицензий;
- методы и подходы по управлению операционными рисками;
- методы и подходы по управлению финансовыми рисками;
- смежные вопросы, затрагивающие управление рисками в управляющей компании;
- фидуциарная ответственность управляющей компании (трактовка Банка России и «подводные камни» такого подхода и риски для управляющей компании);
- типичные ошибки при управления рисками и организации системы управления рисками.

На семинаре будут приведены различные примеры, иллюстрирующие рассматриваемые вопросы.

Дополнительно участники семинара получают информацию о профессиональном стандарте «Специалист по управлению рисками».

ОСНОВНЫЕ ВОПРОСЫ СЕМИНАРА:

1. Введение в управление рисками.
 - 1.1. История вопроса.
 - 1.2. Основная терминология.
 - 1.3. Существующие международные стандарты по управлению рисками
 - 1.4. Подходы по классификации рисков.
2. Особенности текущих регуляторных требований к УК в России.
 - 2.1. Особенности требований по управлению рисками и организации СУР для УК исходя из профиля деятельности.
 - 2.2. Требования к УК ПИФ и НПФ профильных СРО.
 - 2.3. Послабления требований СРО к организации и управления рисками УК ПИФ и НПФ по сравнению с требованиями Банка России для ПУФР.
 - 2.4. Дополнительные требования СРО по управлению рисками УК ПИФ и НПФ по сравнению с требованиями Банка России по организации СУР.
3. Особенности и подходы управления операционными рисками для УК исходя из профиля ее деятельности и регуляторных требований.

- 3.1. Принципы управления рисками.
- 3.2. Организационная структура управления операционными рисками.
- 3.3. Подходы «сверху» и «снизу». Самооценка, анкетирование и иные методы выявления операционных рисков.
- 3.4. Возможная отчетность по управлению операционными рисками с учетом требований СРО для управления рисками УК.
- 3.5. Особенности в деталях.
4. Особенности и подходы управления финансовыми рисками для УК.
 - 4.1. Особенности управления кредитными рисками.
 - 4.2. Особенности управления процентным, валютным и фондовым рисками.
 - 4.3. Вопросы концентрации ликвидности, присущие финансовым рискам.
 - 4.4. Риск-бюджет и оценка совокупного финансового риска инвестиционного портфеля.
5. Смежные вопросы, связанные с риск-менеджментом УК, и особенности оценки совокупного риска.
 - 5.1. Требования МСФО (IFRS) 9 и справедливая стоимость.
 - 5.2. Что может являться нагрузкой на капитал.
 - 5.3. Особенности (коллизии) рекомендаций СРО и Банка России при оценке кредитных рисков.
 - 5.4. Кратко о фидуциарной ответственности. Что это такое и чем грозит?
 - 5.5. Проблематика оценки совокупного риска (финансовые + нефинансовые).
6. Типичные ошибки при организации СУР и управлении рисками. Приложения.
 - 6.1. Кратко о российском стандарте по профессии специалист по управлению рисками.
 - 6.2. Источники и дополнительная литература.

Семинар проводит:

Баранов А. В. — директор департамента риск-менеджмента управляющей компании, преподаватель Института МФЦ. Председатель Комитета ПАРТАД по внутреннему контролю, аудиту и управлению рисками; член Комитета Банка России по стандартам по деятельности управляющих; член Комитета по управлению рисками НАУФОР; Член Экспертного совета по листингу российских эмитентов ПАО «Санкт-Петербургская биржа»; Член Комитета по рынкам коллективных инвестиций ПАО «Московская биржа». Опыт работы на финансовых рынках более 25 лет, из них опыт руководства подразделений по управлению рисками более 10 лет. Является автор более 30 статей по деятельности и управлению рисками в НПФ, УК и др. На годовом Инвестиционном форуме Investor Awards 2013 награжден дипломом «За развитие риск-менеджмента в финансовых (небанковских) институтах».

Место и время проведения: семинар будет проходить в помещении Института МФЦ по адресу: ул. Буженинова, д. 30, стр. 1 Проезд до станции метро «Преображенская площадь». Начало регистрации в 09:40. Время проведения: 10:00 – 14:00. **Возможно участие онлайн.**

Стоимость и скидки. *Стоимость* участия в семинаре для одного участника составляет 9 000 (девять тысяч) рублей, НДС не облагается. *Скидка* в размере 10 процентов предоставляется клиентам Института/Учебного центра МФЦ.

В стоимость включаются: кофе-брейк (для «очных» слушателей) и методические материалы.

Административная информация: заявки на участие *просьба направлять до 11 февраля 2020 г. на имя Ивановой Марии или Махнович Инны по тел./ф. (495) 921-2273 — многоканальный; e-mail: seminar2@educenter.ru, seminar6@educenter.ru, интернет: www.educenter.ru*