



## MANAGEMENTUL RISCOLUI

Managementul Riscului capata o importanta capitala in contextul recesiunii pe plan mondial. Utilizarea unor strategii impotriva riscurilor financiare, implementarea unor proceduri de supraveghere si control, evaluarea si cuantificarea riscului poate reduce substantial pierderile financiare ale unei companii sau institutii financiare.

**Obiectivul** acestui curs este de a va informa si de a va dezvolta abilitati cu privire la:

- strategia managementului riscului in timpul recesiunii
- cunoasterea principiilor de aplicare a protectiilor financiare in perioada recesiunii
- insusirea conceptului si prezentarea modelului de Coporate Risk Management
- calculul valorii la risc si simularea Monte Carlo pentru riscul de piata
- utilizarea instrumentelor financiare derivate in activitatea de Risk Management
- managementul riscului de portofoliu
- cunoasterea unor cazuri celebre intalnite in practica de specialitate

### Cui ne adresam?

- § personal din cadrul institutiilor de credit care au atributii in gestionarea riscului
- § manageri si directori financiari din companii private
- § personal din departamentele financiar-contabile din companii private
- § personal din cadrul SSIF, SVM si alte institutii financiare cu atributii in gestionarea riscului

### Continut

§ **Strategii in Risk Management** (Calculul valorii la risc, Simularea Monte Carlo pentru riscul de piata, Utilizarea derivatelor pentru protejarea portofoliului, Managementul riscului de portofoliu, Rezolvarea crizei de lichiditate, Managementul Creditului)

#### Studii de Caz

- Utilizarea Hedgingului valutar si a altor derivate pentru protectie
- Studiul companiei multinationale NIKE
- Analiza GAP - si rezolvarea crizei de lichiditate

§ **Corporate Risk Management** (Notiuni si principii, Cuantificarea si maparea riscului, Calculul riscului si a indicilor de corelatie, Monitorizarea riscului, Optimizarea portofoliului de riscuri)

#### Studii de Caz

- Compania petroliera NESTE OIL
- Cuantificarea riscurilor si optimizarea portofoliului pentru compania M.
- Calculul riscurilor in industria alimentara

§ **Riscul de credit** (Fundamente ale modelarii riscului de credit; Administrarea riscului de credit si politica de creditare a bancii, Reesalonarea creditelor problema)

#### Studii de Caz

- Analiza financiara a companiilor pentru refinantare
- Reesalonarea creditului? Solutia salvatoare pentru "iesirea din criza"

**Lector - George Constantin**, analist financiar CEC Bank. Absolvent al Institutului Politehnic Bucuresti, a urmat studii postuniversitare la Institutul Politehnic Zurich. A mai ocupat functii de Senior Financial Analyst la Rompetrol si GM Invest, arbitrajist la Bancpost si trezorer microfinantare. A urmat diverse cursuri: Price Risk Management - Londra, Banking Risk Management - Georgetown University, SUA, International banking - Commerzbank, Banking Foundation Level - Charrted Institute of Banker, Londra.

**Perioada** - 14-15 octombrie, orele 9-17, respectiv 9-15.

**Taxa** - lei/persoana

	Institutiile care au platit integral contributia anuala la IBR	Institutiile care nu au platit contributia, alte institutii sau persoane fizice
1 - 2 persoane	675	900
3 - 6 persoane	642	855
7 persoane	608	810

**Persoane fizice** - 900 lei, la care se aplica o **reducere de 10%**, in conditiile achitarii cu 15 zile inainte de inceperea cursului. Taxa include si servicii de catering.

**Plata** se va face in contul Institutului Bancar Roman **RO07 BRMA 0700 0708 9470 0000** deschis la Banca Romaneasca - SMB (pe ordinul de plata va rugam sa specificati numele cursantilor).

**Informatii** - Paunoiu Andreea [andreea.paunoiu@ibr-rbi.ro](mailto:andreea.paunoiu@ibr-rbi.ro)

021-327.48.93