

QuantUp
Artur Suchwaiko
+48-780-085-300
artur@quantup.pl
<http://www.quantup.pl>

Program szkolenia

Zarządzanie ryzykiem ekspozycji kredytowych zabezpieczonych hipotecznie oraz detalicznych ekspozycji kredytowych, czyli Rekomendacja S i T w praktyce – – warsztaty

Prowadzący: Aleksandra Babiarz

1. Rekomendacja S – zasady zarządzania ekspozycjami kredytowymi zabezpieczonymi hipotecznie
 - zakres portfela objęty analizą
 - omówienie wymogów nadzorczych i podejścia do ich implementacji
2. Rekomendacja T – zasady zarządzania detalicznymi ekspozycjami kredytowymi
 - zakres portfela objęty analizą
 - omówienie wymogów nadzorczych i podejścia do ich implementacji
3. Budowa scenariuszy testów warunków skrajnych zgodnie z rekomendacją S i T (case study)
 - przykładowe scenariusze
 - założenia
 - aspekty praktyczne
 - raportowanie
 - okresowe przeglądy scenariuszy testów warunków skrajnych
4. Wyznaczanie limitów wewnętrznych na ryzyko kredytowe (case study)
 - przykładowe limity
 - założenia
 - aspekty praktyczne wyznaczania limitów
 - zarządzanie limitami
 - monitorowanie limitów
5. Audyt zagadnień objętych rekomendacją S i T (case study)
 - najważniejsze aspekty