
LETNIA SZKOŁA RYZYKA

AKADEMII COMPLIANCE

kolejna edycja I warsztatu

Akademia Compliance

Akademia Compliance jest forum wymiany myśli, wiedzy oraz kontaktów pomiędzy pracownikami instytucji finansowych. Główną ideą przyświecającą Akademii Compliance jest dzielenie się praktyczną wiedzą z przedstawicielami biznesu oraz działów compliance, audytu i jednostkami zarządzania ryzykiem.

Letnia Szkoła Ryzyka – cykl warsztatów dla członków zarządu, rad nadzorczych, komitetów audytu i ryzyka, audytorów, compliance officerów oraz specjalistów zarządzania ryzykiem nakierowany na uzyskanie wiedzy w zakresie wymogów i praktyki zarządzania ryzykiem w domu/biurze maklerskim.

Udział w warsztatach ma na celu poszerzenie wiedzy uczestników m.in. z zakresu: ryzyk identyfikowanych w domach maklerskich, wymagań nadzorczych w zakresie zarządzania tymi ryzykami, tworzenia i zmian systemu zarządzania ryzykiem i kapitałem oraz kontroli wewnętrznej w oparciu o wymagania nadzorcze (CRR/CRDIV, BION) oraz standardy rynkowe w tym zakresie.

Wykładowcy Letniej Szkoły Ryzyka Akademii Compliance

Marcin Malinowski - radca prawny, absolwent Wydziału Prawa i Administracji Uniwersytetu Warszawskiego oraz Szkoły Głównej Handlowej, absolwent aplikacji radcowskiej prowadzonej przez Okręgową Izbę Radców Prawnych w Warszawie. Doświadczenie zawodowe zdobywał pracując w kancelariach prawnych, instytucjach publicznych oraz instytucjach finansowych. W latach 2007 – 2009 będąc pracownikiem Ministerstwa Finansów był bezpośrednio zaangażowany w proces implementacji do polskiego systemu prawnego m.in. dyrektyw MiFID oraz dyrektyw Transparency. Jako przedstawiciel Polski brał udział w pracach legislacyjnych Rady Unii Europejskiej dotyczących nowych regulacji w zakresie prawa rynku kapitałowego. Jako konsultant i pracownik instytucji rynku finansowego był odpowiedzialny za przygotowanie i prowadzenie postępowań administracyjnych związanych z nadzorem wykonywanym przez Komisję Nadzoru Finansowego, jak również za bieżącą obsługę prawną towarzystw funduszy inwestycyjnych oraz domów maklerskich. Jako pracownik Wydziału Zawiadomień i Legislacji Departamentu Funduszy Inwestycyjnych w Urzędzie Komisji Nadzoru Finansowego był odpowiedzialny m.in. za przygotowanie projektów aktów prawnych implementujących dyrektywy UCITS IV i ZAFI do polskiego porządku prawnego. Wykonując zawód



radcy prawnego specjalizuje się w prawie finansowym, ze szczególnym uwzględnieniem prawa rynku kapitałowego.

Justyna Czekaj – radca prawny z ponad 10-letnim doświadczeniem w komórkach nadzoru wewnętrznego w instytucjach finansowych oraz audycie wewnętrznym. Specjalizuje się w prawie cywilnym, ze szczególnym uwzględnieniem prawa handlowego, prawa bankowego oraz prawa rynków kapitałowych. Posiada praktyczną wiedzę związaną z wdrażaniem przepisów dyrektyw UE dotyczących rynku kapitałowego. Prowadziła warsztaty, m.in. w zakresie: compliance w działalności firm inwestycyjnych, TFI. Założycielka Akademii Compliance.

Informacje o programie

Poziom I Podstawowy	Poziom II Średniozaawansowany	Poziom III Zaawansowany
I warsztaty: Wstęp do ryzyka	II warsztaty: Zarządzanie ryzykiem	III warsztaty: Zarządzanie ryzykiem dla managerów ds. ryzyka.
Warsztat dla członków zarządów, rad nadzorczych, komitetów audytu, audytorów i compliance officerów nakierowany na podstawowe informacje dotyczące zarządzania ryzykiem w domu/biurze maklerskim. Program warsztatu jest dostosowany dla wszystkich, którzy chcą zapoznać się z zarządzaniem ryzykiem lub usystematyzować swoją wiedzę w tym zakresie.	Warsztat skierowany do pracowników zajmujących się na co dzień analizą ryzyka oraz osób pragnących zasięgnąć dodatkowych informacji i zdobyć nowe umiejętności w tym przedmiocie, w szczególności do osób odpowiedzialnych za przygotowanie dokumentów w ramach oceny nadzorczej BION.	Warsztat skierowany do pracowników zajmujących się analizą ryzyka, osób nadzorujących pracowników ryzyka oraz dla osób, które po odbyciu poprzednich warsztatów mają zamiar kontynuować zdobywanie wiedzy w tym zakresie.

Potwierdzenia udziału

Uczestnicy otrzymają potwierdzenie udziału w warsztatach z danego poziomu.

Egzamin oraz certyfikat

Niezależnie od potwierdzeń udziału, uczestnicy biorący udział we wszystkich trzech sesjach szkoleniowych będą mogli przystąpić do egzaminu sprawdzającego zdobytą podczas warsztatów wiedzę. Po pozytywnym zaliczeniu egzaminu uczestnik otrzyma certyfikat Akademii Compliance potwierdzający zapoznanie z materiałami prezentowanymi podczas warsztatów i profesjonalne przygotowanie do zagadnienia zarządzania ryzykiem.

Zarówno przystąpienie do egzaminu, jak i uzyskanie certyfikatu jest bezpłatne dla słuchaczy uczestniczących w trzech modułach.



Forma warsztatów

W ramach warsztatów przewidujemy ćwiczenia na przykładowych danych w programie Excel.

Każdy uczestnik otrzyma dodatkowe materiały dotyczące zagadnień omawianych podczas szkolenia do samodzielnej analizy.

Program I warsztatu **Letniej Szkoły Ryzyka** w dniu 15 września 2016 r.

Wstęp do ryzyka – warsztat dla audytorów i compliance officerów nakierowany na podstawowe informacje dotyczące zarządzania ryzykiem w domu/biurze maklerskim.

Program warsztatu jest dostosowany dla wszystkich, którzy chcą zapoznać się z podstawami zarządzania ryzykiem lub usystematyzować swoją wiedzę w tym zakresie.

Dzięki szkoleniu uczestnicy będą znali ryzyka identyfikowane w domach maklerskich, rozumieli wymagania nadzorcze w zakresie zarządzania tymi ryzykami oraz nabędą wiedzę dotyczącą konstrukcji systemu zarządzania ryzykiem i kapitałem, oraz kontroli wewnętrznej w oparciu o wymagania nadzorcze (CRR/CRDIV, BION), jak też standardy rynkowe w tym zakresie.

Uczestnicy otrzymają m.in. przykładowe kryteria pomagające identyfikować występowanie ryzyk w domu maklerskim. Warsztaty pozwolą zrozumieć połączenia pomiędzy poszczególnymi elementami systemu zarządzania ryzykiem.

SZCZEGÓŁOWY PROGRAM:

Rejestracja: 9:00-9:30

- 1) Dom maklerski – miejsce w przestrzeni instytucji finansowych, nadzorowanych przez KNF i objętych wymaganiami CRR/CRD IV.
- 2) Uwarunkowania zewnętrzne wpływające na funkcjonowanie domów maklerskich:
 - a) regulacyjne (omówienie podstawowych regulacji dot. działania DM oraz ich zmian w ostatnich latach),
 - b) ekonomiczne – jak kryzys finansowy 2008r. przełożył się na wymagania ujęte w m.in. w CRR/CRD IV.

Przerwa kawowa: 11:15-11:30

- 3) Wyjaśnienie podstawowych pojęć związanych z ryzykiem.
- 4) Zarządzanie ryzykiem i kapitałem – podstawowe definicje (omówienie zasad wyliczania wymogów kapitałowych oraz procesu ICAAP).
- 5) Ryzyka w działalności domu maklerskiego (w oparciu o szczegółową listę ryzyk wskazaną w metodyce BION oraz praktykę rynkową):
 - a) Ryzyka uwzględniane w wyliczeniu kapitału regulacyjnego (m.in. ryzyko rynkowe, kredytowe i operacyjne),
 - b) Ryzyko koncentracji, jako szczególna podgrupa ryzyka kredytowego,



- c) Ryzyko płynności,
- d) Ryzyko modeli,
- e) Ryzyko biznesowe,
- f) Ryzyko strategiczne,
- g) Ryzyko reputacji,
- h) Ryzyko kapitałowe,
- i) Ryzyko zarządzania,
- j) Ryzyko nadmiernej dźwigni,
- k) Ryzyko makroekonomiczne.

Lunch: 14:00-14:30

6) Zarządzanie ryzykami:

- a) Pojęcia: fundusze własne/kapitał wewnętrzny/ekspozycja na ryzyko/filary I i II oraz zależności między nimi versus współczynniki kapitałowe,
- b) Polityka zarządzania ryzykiem i kapitałem,
- c) Identyfikacja Ryzyka,
- d) Pomiar ryzyka i kapitału – podstawy,
- e) Raportowanie ryzyka i kapitału (w tym potencjalne trudności w raportowaniu, najczęstsze błędy),
- f) Ocena nadzorcza (SREP/BION).

7) Podsumowanie warsztatu: odpowiedzi na pytania.

Terminy

Poziom początkujący kolejna edycja– 15 września 2016 r.

Poziom średniozaawansowany – drugi tydzień października 2016 r.

Poziom zaawansowany – listopad/grudzień 2016 r.

Konkretne daty podane zostaną w późniejszym terminie.

Czas trwania każdego z warsztatów to 6 godzin szkoleniowych.

Warunki płatności wynagrodzenia

Wynagrodzenie w wysokości 1000zł netto za uczestnictwo jednej osoby w jednej sesji szkoleniowej (jeden dzień szkoleniowy) płatne przed odbyciem warsztatu na rachunek bankowy wskazany w formularzu zgłoszeniowym.

Wszyscy uczestnicy wcześniejszych szkoleń organizowanych przez Akademię Compliance otrzymają atrakcyjne zniżki.