

СБОРНИК ДОКЛАДОВ + CD
Третья Ежегодная Банковская Конференция

УПРАВЛЕНИЕ ОПЕРАЦИОННЫМИ РИСКАМИ

Киев, 9-10 апреля 2014

9-10 апреля 2014 года в Киеве с успехом прошла Третья Ежегодная Банковская Конференция «Управление операционными рисками: современные методы и технологии»

Целью Конференции являлся обмен опытом в области эффективного управления операционными рисками в банках и внедрения современных информационных технологий в этой области.

Конференция прошла при участии Глобальной Ассоциации Профессионалов Риск Менеджмента (GARP), Правекс Банка, Пиреус банка и Украинско-Британской Профессиональной Ассоциации (UUPN). Главный интернет-медиа партнер – Финансовый портал Finance.ua. Информационные партнеры Конференции – Аналитический Банковский журнал, информационное агентство РБК-Украина, банковские порталы mInfin.com.ua, cfin.ru, infobank.by. Организатор Конференции – компания Экстра Консалтинг.

Открыл конференцию доклад Доминика Меню, Главы Представительства BNP Paribas в Украине и Казахстане, Члена Наблюдательного Совета УкрСиббанка, который остановился на перспективах развития мировой экономики, банковского сектора и регулирования банковской деятельности и их влияния на управление рисками в банках.

На Панельной дискуссии, последовавшей далее, Игорь Францкевич, Председатель Управляющего комитета GARP Украина, Вадим Березовик, Член Управляющего Комитета GARP Украина, Вячеслав Коваль, и.о. Председателя Правления Пиреус Банка МКБ и Виталий Дыдышко, FRM, Начальник управления рисков Сбербанка России, обсудили актуальные проблемы организации и управления операционными рисками в банках.

Методам и инструментам управления операционными рисками в банке были посвящены доклады Елены Дмитриевой, Заместителя Председателя Правления Укргазбанка и Владимира Иванова, Начальника отдела операционных рисков, Сбербанк России.

Особый интерес вызвала сессия, на которой были затронуты риски мошенничества и методы их управления. На ней выступили Татьяна Ярошенко, руководитель управления операционных рисков и постоянного контроля УкрСиббанка, Юлия Ворчак, Начальник Центра управления рисками розничного бизнеса Фидобанка, и Денис Осипенко, Консультант Экстра Консалтинг, докторант Центра исследования кредита при Бизнес школе Эдинбургского Университета (Великобритания). Докладчики поделились своим опытом в идентификации мошенничества, в применении фрод- сокринга и Data Mining при использовании информации из социальных сетей в противодействии мошенничеству.

На конференции поднимались вопросы управления и другими операционными рисками. Доклад Алены Гавуры, Начальника Департамента банковской организации Укрсоцбанка был посвящен особенностям работы проектного офиса в банке и пониманию ключевых проектных рисков. Тамара Польская, начальник управления операционными рисками Райффайзен Банк Аваль, остановилась на практике управления юридическим риском, а Евгений Плотца, бывший Заместитель Председателя Совета Директоров Дельта Банка, чей доклад был признан лучшим участниками конференции, детально проанализировал ИТ риски в банках.

Наиболее актуальной и вызывающей особый интерес была Панельная дискуссия риск менеджеров и юристов банков на тему «Пути решения правовых проблем для банков, связанных кризисом в Украине и аннексией Крыма». Олехов Игорь, Партнер Baker&McKenzie, Максим Гринченко, Член Правления, Директор юридического департамента Пиреус Банка МКБ и Александр Демьяненко, руководителем управления Финансового Мониторинга Укрсиббанка, постарались ответить на нелегкие вопросы о правовых аспектах, последствиях и способах разрешения проблем, возникших в результате экономического и политического кризиса, о способах трансформации филиалов и отделений банков Украины, находящихся на территории Крыма, о трансформация договорных отношений между банками и клиентами – резидентами Крыма.

По окончании Конференции также состоялось Заседание Регионального отделения GARP в Украине на тему «Проходя наихудший сценарий: Макроэкономические вызовы и риски в Украине», на котором выступил Дмитрий Сологуб, CFA, Начальник отдела анализа и исследований Райффайзен Банка Аваль. Его доклад был встречен с большим интересом и вызвал бурную дискуссию участников.

Для тех из Вас, кто не смог принять в ней участие, мы предлагаем заказать Сборник Докладов. Это – переплетенная книга формата А4 объемом 100 страниц, содержащая доклады, сделанные на конференции. Сборник Докладов включает также **диск CD**, который содержит **все презентации**, сделанные на Конференции, в электронном виде.

Ниже приводится Содержание Сборника докладов. Заказанные Сборники Докладов будут отправлены Вам почтой в течение 3-х рабочих дней с момента их оплаты. Для оформления заказа, пожалуйста, заполните форму заявки, которая прилагается ниже, и вышлите ее нам по e-mail: office@extra-consulting.net . Тел +38 044 227-81-73

СОДЕРЖАНИЕ
СБОРНИКА ДОКЛАДОВ
Третья Ежегодная Банковская Конференция

УПРАВЛЕНИЕ ОПЕРАЦИОННЫМИ РИСКАМИ

9-10 апреля 2014

Сессия 1. Перспективы развития банковского сектора и регулирования банковской деятельности и их влияния на управление рисками в банках: международный и украинский контекст

Как выстоять в период кризиса ликвидности? *

Dominiqne Menu (Доминик Меню), Глава Представительства, BNP Paribas в Украине и Казахстане, Член Наблюдательного Совета, УкрСиббанк

Сессия 2. Методы и инструменты управления операционными рисками в банке

Инциденты – что, как и почему? ... 1

Иванов Владимир Геннадьевич, Начальник отдела операционных рисков, Сбербанк России

- Организация процесса сбора и анализа инцидентов.
- Внешние события – стоит ли игра свеч? На какие из них стоит обращать внимание и мониторить? Их использование при сценарном анализе экстремальных событий.
- Что имеем в «сухом остатке»? Какие бенефициары получает?

Минимизация операционных рисков при работе по взысканию проблемной задолженности ... 22

Дмитриева Елена Михайловна, Заместитель Председателя Правления, Укргазбанк

- Основные виды операционных рисков, которые возникают в Банке при работе с проблемной задолженностью. Освещение мероприятий по предотвращению (минимизации) этих рисков.
- Реальные примеры из практики Банка по операционным рискам.
- Схема взаимодействия структурных подразделений в работе по минимизации операционных рисков.
- Управленческая отчетность, освещающая основные бизнес линии Банка по проблемной задолженности с разделением на основные виды рисков.
- Освещение риск-индикаторов с целью выявления основных критических зон.

Сессия 3. Практика управление рисками мошенничества

Практика противостояния мошенничеству в банке ... 41

Ярошенко Татьяна, руководитель управления операционных рисков и постоянного контроля, УкрСиббанк

Применение Data Mining и Фрод-Скоринга для предотвращения внешнего и внутреннего мошенничества в розничном кредитовании ... 52

Осипенко Денис Вячеславович, Консультант, Экстра Консалтинг, докторант, Центр исследования кредита при Бизнес школе Эдинбургского Университета (Великобритания)

- Идентификация мошенничества на этапе выдачи кредита и в чем бесценен аппликационный скоринг
- Аналитические системы противодействия мошенничеству: проверка целостности, последовательности и логичности информации. Поиск скрытых связей: data mining и применение социальных сетей.

- Фрод-скоринг - оценка вероятности мошеннических действий клиента и место в системе принятия решений
- Идентификация и мониторинг внутреннего мошенничества с помощью аналитических систем

Мошенничество – система, развитие которой необходимо предугадывать ... 69

Ворчак Юлия Владимировна, Начальник Центра управления рисками розничного бизнеса, **Фидобанк**

- Процесс кредитования и виды мошенничества
- Сотрудник отделения: мотивация и реальные схемы кредитования
- Работа с поддельными документами
- Искажение клиентской информации.
- Пост-контроль: способы выявления и их эффективность.

Сессия 4. Практика управления другими операционными рисками в банке

Управление операционными рисками в работе проектного офиса *

Гавура Алена, Начальник Департамента банковской организации, **Укрсоцбанк, Группа Юникредит**

- Особенности работы проектного офиса в банке
- Понимание ключевых проектных рисков
- Дифференциация рисков реализации проектов – анализ и управление
- Влияние операционных рисков Банка на работу проектного офиса

To be or not ... IT. Банковское IT - источник операционных рисков или инструмент их минимизации? ... 84

Плотица Евгений Михайлович, Заместитель Председателя Совета Директоров, **Дельта Банк**

Практика управления юридическим риском *

Глевацкий Андрей Александрович, Директор Департамента розничных, рыночных и операционных рисков, **Райффайзен Банк Аваль**

** - данные доклады не вошли в Сборник, но представлены в электронном виде на диске, который прилагается к Сборнику.*

Стоимость комплекта (один экземпляр сборника докладов вместе с диском) – 1400 грн., без НДС (единый налог). При заказе двух и более экземпляров – стоимость каждого дополнительного комплекта – 200 грн. В стоимость входят почтовые расходы.

За дополнительной информацией, пожалуйста, обращайтесь в компанию «Экстра Консалтинг» по тел. (044) 227 81 73 или e-mail: office@extra-consulting.net

.....

ЗАЯВКА
на получение
СБОРНИК ДОКЛАДОВ + CD

СБОРНИКА ДОКЛАДОВ
Третья Ежегодная Банковская Конференция

УПРАВЛЕНИЕ ОПЕРАЦИОННЫМИ РИСКАМИ

9-10 апреля 2014

Мы желаем получить ___ комплект(ов) **Сборника Докладов Конференции** по цене 1400 грн. за первый комплект и 200 грн. за каждый дополнительный комплект.

Название организации: _____

Контактное лицо: _____

Контактный телефон: (____) _____

E-mail: _____

Заказанные материалы вышлите по следующему адресу:

Кому: _____

Должность: _____

Почтовый адрес (с индексом): _____

Руководитель _____

*Заявку, пожалуйста, направьте по факсу +38 (044) 418 59 94 или
на e-mail office@extra-consulting.net*