

Tržišni rizici



Tržišni rizici su jedan od najproučavanijih, a istovremeno i najvažnijih elemenata financijskih rizika. Banke i poduzeća preuzimaju sve više tržišnih rizika kako bi se poboljšala njihova učinkovitost. Još od početka financijske krize, organizacije su bile sve više usmjerene na upravljanje tim rizicima. Njihovim rukovanjem i zaštiti posvećuju sve više vremena i sredstava.

Cilj radionice

Na radionici želimo učesnike upoznati s okvirom koji se može koristiti od strane financijskih institucija, institucionalnih investitora i poduzeća za identifikaciju, mjerenje i izvještavanje o tržišnim rizicima. Prezentiran će biti detaljan pregled upravljanja tržišnim rizicima, uključujući mjerenje rizika, sustav limita, politike i ključne kontrole. Nakon diskusije o određenim tržišnim rizicima, detaljnije će biti prezentirani instrumenti i metode koje se koriste za upravljanje pojedinim rizicima.

Način rada

Radionica se sastoji od teorije upravljanja tržišnim rizicima, diskusija, kratkih primjera i vježbi.

Također je pogodna za sve one koji se bave tržišnim rizicima svakodnevno i koji bi željeli dopuniti svoje znanje s dodatnim primjerima iz prakse.

Na kraju radionice učesnici će biti osposobljeni za razmatranje i ocjenjivanje različitih tržišnih rizika, kao i izvoditi potrebna ograničenja i kontrole.

Učesnici će nakon seminara bolje razumjeti različite vrste tržišnih rizika koje su prisutne na financijskim tržištima, kao i postupke i ograničenja koja su potrebna za učinkovito upravljanje njima.

Sadržaj radionice

- Uvod u tržišne rizike
- Kategorije tržišnog rizika
 - tečajni rizik
 - rizik kamatnih stopa
 - rizik cijene dionica
 - robni rizik
- Volatilnost
- Utjecaj diversifikacije na portfelj
- Rizik i tolerancija prema riziku
- Kontroliranje rizika u valutnom trgovanju
- Kontroliranje rizika na tržištu novca
- Kontroliranje rizika u poslovanju s obveznicama
- Kontroliranje rizika u poslovanju s dionicama
- Kontroliranje rizika u poslovanju s izvedenim financijskim instrumentima
- Limiti i proces kontrola
- Kultura i struktura organizacije
- Uvod u koncept rizične vrijednosti (Value at Risk - VaR)

Radionica je namijenjena:

- stručnjacima s područja upravljanja rizicima,
- rizničarima u bankama i poduzećima koji se svakodnevno suočavaju s tržišnim rizicima u svojem poslovanju ili tokom uporabe različitih strategija financiranja,
- povjerenicima poduzeća i komercijalistima koji nude različite bankarske proizvode i moraju u svom radu savjetovati poduzećima o tržišnim rizicima i korišćenju najprikladnijih rješenja za njihovo upravljanje,
- trgovcima financijskim instrumentima,
- burznim posrednicima,
- fond menadžerima,
- zaposlenicima u računovodstvu i reviziji,
- osoblju u praćenju trgovanja,
- osoblju regulatornog izvještavanja,
- ostalim zaposlenicima u bankama koji su zainteresirani za metode upravljanja tržišnim rizicima.

Raspored radionice

9.00–10.30	Uvod u tržišne rizike <ul style="list-style-type: none">• opća definicija rizika• razlozi za upravljanje rizicima Tržišni rizik Upravljanje rizikom na tržištu novca	13.30–15.00	Upravljanje tržišnog rizika u poslovanju s devizama i izvedenim financijskim instrumentima Limiti i proces kontrola
10.30–10.45	Pauza	15.00–15.15	Pauza
10.45–12.30	Upravljanje tržišnog rizika u poslovanju s obveznicama i dionicama	15.15–16.30	Metode za mjerenje tržišnog rizika <ul style="list-style-type: none">• volatilnost• Value at Risk (VaR)
12.30–13.30	Pauza za ručak	16.30	Zaključak radionice