

24-25 марта 2026 года, Сафмар Тверская Москва

Докладчики:

Банк России
Сбербанк
Банк ВТБ
Газпромбанк
Альфа-Банк
Россельхозбанк
ГК Finbrige
Московский
кредитный банк
ИК «РЕГИОН»
Финам
Банк Держава
МП Банк
НБКИ
Росагролизинг
Альфа-Банк
(Беларусь)
Сбер страхование
Московская Биржа
Эм-Ю-Эф-Джи Банк
(Евразия)
Банк БелВЭБ
Банк ПСБ

- Оценка кредитных рисков на основе «продвинутого подхода» от **Банка России**
- Новые подходы в **Банке ВТБ** к расчёту ПДН и последствия для макропруденциальных лимитов и надбавок
- Эволюция системы риск-менеджмента и ее роль в повышении эффективности управления банком от **Московского кредитного банка**
- Сценарный прогноз ситуации в экономике России в условиях дефицита данных от **Газпромбанка**
- Модельный риск во внутреннем и внешнем ценообразовании банковских продуктов в **Россельхозбанке**
- Влияние жёсткой денежно-кредитной политики на корпоративных заёмщиков от **ИК «РЕГИОН»**
- Макроэкономическая турбулентность и инвестиционно-банковский цикл в компании от **Финам**
- Стресс-тестирование как инструмент управления операционными рисками в **Газпромбанке**
- Вопросы кооперации и коллаборации в части противодействия мошенничеству в странах СНГ от **ГК Finbrige**
- Методы и критерии валидации моделей оценки рисков в **Банке ПСБ**
- Развитие риск-культуры как элемент повышения эффективности риск-менеджмента в **Альфа-Банке**
- Повышение операционной эффективности через призму управления операционными рисками в **Банке БелВЭБ**
- Прогнозирование экономических кризисов для управления рисками в **Банке Держава**
- Управление ликвидностью и снижение процентного риска банковской книги в **Банке ВТБ**
- Риски новых технологий и способы их оценки: опыт **Московской Биржи**
- Методология сегментации кредитного портфеля в **Банке ПСБ** в процессе ПВР-моделирования
- Взаимодействие бизнеса и системы управления рисками для повышения эффективности в **Росагролизинге**
- Обзор практики учета климатических рисков в деятельности кредитных организаций от **Эм-Ю-Эф-Джи Банк (Евразия)**
- AIDriven решения на основе резервуарных вычислений и диффузионных моделей в задачах прогнозирования доходностей структурных нот в **Газпромбанке**

**Время одного выступления докладчика 20-25 минут,
в конце доклада 5-10 минут на вопросы и ответы**

Медиа-партнеры



По всем вопросам звоните + 7 495 649 84 14 или info@dialogmanag.com

09.00 **Регистрация участников****09.30** **Сценарный прогноз ситуации в экономике России в условиях дефицита данных**

Дарья Тарасенко, старший аналитик Центра экономического прогнозирования
Газпромбанк

- Мировая и российская экономика находятся в процессе утраты бенчмарков – это касается как сырьевых, так и финансовых рынков.
- Деглобализация мировой экономики и разрывы в цепочках поставок привели к тому, что цены на товары в разных регионах мира стали различаться. Эти различия усилились с нарастанием торговых противоречий в мире. Узнавать о ситуации в России, используя данные зарубежных бирж и ценовых агентств становится невозможно. Источники данных о ценах на сырье в России крайне ограничены. Схожая ситуация – на российском валютном рынке.
- Макроэкономический прогноз на 2026-2027 гг. Основные сценарии и риски. На какие данные можно опираться при прогнозировании макроэкономических показателей?
- Вопросы и ответы

10.00 **Эволюция системы риск-менеджмента и ее роль в повышении эффективности управления банком**

Максим Смирнов, Директор департамента рыночных и операционных рисков
Московский кредитный банк

- Как управление рисками в банке помогает повышению эффективности управления банком: переход от риск-концепции «красных линий» к выбору оптимального варианта с учетом влияния на риск
- Нулевой уровень: регуляторный минимум
- Базовый уровень: системы лимитов кредитного и рыночного риска
- Базовый плюс: сценарный анализ и стресс-тестирование
- Продвинутый уровень: встраивание процессов управления ALM рисками (и другими) в систему принятия бизнес-решений
- Управление операционным риском: не регуляторная формальность, а инструмент повышения эффективности процессов банка
- Вопросы и ответы

10.30 **Риски новых технологий и способы их оценки: опыт Московской Биржи**

Дарья Соловьева, начальник Управления операционных рисков
Ольга Миньзюк, руководитель направления оценки нефинансовых рисков
Московская Биржа

- AI-Риск как системный контроль
- MLSecOps: превентивное управление целостностью данных (стратегия «Shift-Left»)
- Трассируемость решений и аудит
- Контроль критичных зависимостей: установление биржевых стандартов для поставщиков

11.00 **Перерыв на кофе****11.45** **Оценка кредитных рисков на основе «продвинутого подхода»**

Светлана Макеева, Руководитель направления, Отдел надзора за моделями для целей расчета регуляторного капитала, ДНСЗКО
Банк России

- Влияние подхода на внутренних рейтингах на норматив достаточности капитала
- Моделирование компонент кредитного риска на основе подхода на внутренних рейтингах
- Надзор за Кредитными организациями, применяющими подход на внутренних рейтингах

12.15 **Новые подходы к расчету ПДН и последствия для макропруденциальных лимитов и надбавок**

Александр Громов, управляющий директор департамента анализа данных и моделирования
Банк ВТБ

- Какие изменения в порядке расчета показателя долговой нагрузки (ПДН) повлияют на макропруденциальные лимиты (МПЛ) и надбавки (МПН)
- Какие изменения произошли в требованиях на использование модельного подхода в расчете ПДН и как поменяется эффект от применения модельного подхода
- Дорожная карта ЦБ РФ перехода к использованию официальной информации о доходах при расчете ПДН. Влияние на расчет МПЛ и МПН. Какие открытые вопросы требуют внимания

12.45 **Как банку строить защиту вокруг AI-агентов. Архитектура, риски и практика управления GenAI**

Владимир Никулин, Управляющий директор, Блок "Риски", Управление операционных рисков, Технориски
Сбербанк

- От «модели, которая отвечает» к «агенту, который действует»
- Почему AI-агент опаснее, чем кажется?
- Как определить уровень автономности и где нужен человек
- Трехслойная защита: что проверять до запуска, во время работы и после

13.15 Перерыв на обед

14.30 Стресс-тестирование как инструмент управления операционными рисками в современном банке

Вадим Ситосенко, Начальник Департамента операционных рисков
Газпромбанк

- Методология стресс-тестирования операционных рисков: подходы и практики
- Практическое применение результатов стресс-тестов: корректирующие меры и улучшение процессов
- Регуляторные требования и лучшие практики в области стресс-тестирования
- Вопросы и ответы

15.00 Методы и критерии валидации моделей оценки рисков

Михаил Помазанов, Руководитель по валидации, Дирекция рисков
Банк ПСБ

- Валидация с собственными критериями оценки или от Банка России
- «Зеленая» оценка параметра модели, что необходимо для получения
- Примеры валидационных тестов для оценки кредитоспособности компаний, потерь при дефолте, рыночного риска, себестоимости и прочее
- Вопросы и ответы

15.30 Повышение стабильности PD-модели по науке: как ограничить волатильность факторов в рейтинговой модели

Алексей Сидоров, Управляющий директор Департамент моделирования кредитных и финансовых рисков
Газпромбанк

- Компромисс между точностью и стабильностью
- Как правильно определять волатильность финансовых факторов
- Почему правильно усреднять – сложнее, чем кажется
- Вопросы и ответы

16.00 Перерыв на кофе

16.30 Повышение операционной эффективности через призму управления операционными рисками

Снежана Денищик, Заместитель директора Департамента риск-менеджмента
Банк БелВЭБ

- Новый взгляд на операционный риск в условиях трансформации

- Стратегический подход: интеграция управления операционным риском в бизнес-процессы
- Вызовы и перспективы
- Вопросы и ответы

17.00 Что руководство и регулятор будут ожидать от внутренних процедур оценки достаточности капитала (ВПОДК) на практике

Рауф Рагимов, Заместитель Председателя Правления
МП Банк

- Изменение требований Банка России к внутренним процедурам оценки достаточности капитала
- Адекватность ВПОДК риск-профилю банка через корректное отражение значимых рисков и чувствительность к стресс-факторам
- Использование KRI и KPI в контуре ВПОДК как инструментов управления и мотивации персонала
- Встраивание результатов ВПОДК в управленческий цикл и их использование органами управления при принятии решений
- Вопросы и ответы

17.30 Макроэкономическая турбулентность и инвестиционно-банковский цикл

Ярослав Кабаков, директор по стратегии
Финам

- Рост влияния денежно-кредитной политики и регуляторов на динамику финансового сектора
- Новые условия инвестирования и финансирования: переход к инструментам типа долговых обязательств и структурированных продуктов
- Возрастание значимости управления рисками, включая управление процентными ставками, ликвидностью и механизмами рефинансирования
- Нарастание уровня нелинейных рисков, обусловленных неопределённостью внешней среды
- Внедрение новых методов оценки риска: сценарного анализа и регулярных стресс-тестирований для повышения устойчивости банковской системы
- Вопросы и ответы

18.00 Заключительное слово модератора и закрытие 1-го дня конференции

09.00 **Регистрация участников**

09.30 **Влияние жесткой денежно-кредитной политики на корпоративных заемщиков**

Валерий Вайсбер, директор аналитического департамента
ИК РЕГИОН

- Рост ключевой ставки vs эффективная процентная ставка корпоративных заемщиков
- Новое в управлении капиталом корпоративных заемщиков
- Динамика долговых метрик и оценок кредитного качества корпоративных заемщиков
- Премии за риск корпоративных заемщиков
- Вопросы и ответы

10.00 **Прогнозирование экономических кризисов для управления рисками**

Владимир Левченко, Вице-президент департамента рынков капитала
Банк Держава

- Почему прогнозированием кризисов почти никто не занимается?
- Что дает прогнозирование кризисов для экономики и бизнеса?
- Методика прогнозирования и использование результатов в работе
- Вопросы и ответы

10.30 **Вопросы кооперации и коллаборации в части противодействия мошенничеству в странах СНГ**

Игорь Ермак, Директор по операционным рискам
ГК Finbrige

- Анализ основных вызовов в части актуальных схем мошенничества
- Анализ технологий в разных странах в части предотвращения и профилактики мошенничества
- Изучение вопросов коллаборации между странами в части борьбы с мошенническими группами
- Роль ИИ в упрощении жизни мошенникам и как реагировать банкам и ФинТех компаниям
- Взгляд на перспективы создания единого антифрод центра для совместной борьбы с мошенничеством
- В чем мы едины, в чем различны и как можем усилить друг друга в борьбе с единым злом, мошенничеством

11.00 **Перерыв на кофе**

11.30

Управление ликвидностью и снижение процентного риска банковской книги

Елена Ковылянская, Управляющий директор, лидер команды Количественные Финансы, департамент анализа данных и моделирования
Банк ВТБ

- Назначение процентных ставок в контексте привлекательности банковских продуктов и снижения процентного риска банковской книги и риска ликвидности
- Подходы к стресс-тестированию и сценарного анализа для оценки кредитного риска при высоких процентных ставках
- Практические вопросы корреляции процентного риска с кредитным, риском ликвидности и другими видами рисков в розничных кредитных продуктах
- Вопросы и ответы

12.00

Методология сегментации кредитного портфеля в процессе ПВР-моделирования

Юрий Полянский, начальник Управления разработки ПВР-моделей
Банк ПСБ

- Принципы формирования регуляторных классов (подклассов) и внутренних сегментов кредитных требований в целях ПВР
- Принципы организации портфелей применения моделей ПВР
- Принципы формирования и определения границ и составов рейтинговых систем
- Критическое значение правильной нарезки портфеля для эффективного построения и применения моделей ПВР
- Практические примеры эффективной нарезки кредитного портфеля в целях ПВР
- Релевантность и репрезентативность - 2 различных свойства наборов данных, используемых в ходе ПВР-моделирования
- Требования регуляторов к сегментации кредитного портфеля, общие подходы и практические ограничения
- Вопросы и ответы

12.30

Эволюция подходов к оценке рисков аутсорсинга

Ольга Ледебева, Директор департамента, интегрированного риск-менеджмента
Альфа-Банк (Беларусь)

- Современные вызовы и новые регуляторные требования
- Какие критерии должны учитываться при выстраивании эффективной системы управления риском аутсорсинга исходя из специфики направления деятельности банка
- Взаимодействие бизнеса и рисков в процессе оценки рисков аутсорсинга: главные факторы повышения эффективности работы
- Вопросы и ответы

13.00

Перерыв на обед

14.00 Модельный риск во внутреннем и внешнем ценообразовании банковских продуктов

Андрей Козлаков, Начальник управления методологического и технологического развития Департамента внутреннего казначейства

Россельхозбанк

- Как внедряя искусственный интеллект, создавая даже точные модели прогнозирования избежать модельного риска, способного увести в минус фактический экономических эффект
- Как определить ожидаемый и фактический экономические эффекты от внедрения
- Вопросы и ответы

14.30 Развитие риск-культуры как элемент повышения эффективности риск-менеджмента в банке

Елена Носова, руководитель направления по операционным рискам

Дарья Пунина, Главный эксперт по операционным рискам

Альфа-Банк

- Риск-менеджмент в Альфа-Банке: основные принципы и составные элементы
- Интеграция риск-культуры в стратегию развития управления рисками Банка
- Развитие модели превентивного управления операционными рисками на примере Цифровых каналов
- Вопросы и ответы

15.00 Взаимодействие бизнеса и СУР: главные факторы повышения эффективности работы

Александра Лушина, Консультант по стратегическим вопросам

Росагролизинг

- Синергия задач СУР с глобальными бизнес-целями компании
- Переход от традиционного подхода к сотрудникам как ресурсу к взаимодействию как равноправному партнёру
- Повышение эффективности за счёт внедрения цифровых решений и автоматизации процессов
- Вопросы и ответы

15.30 AIDriven решения на основе резервуарных вычислений и диффузионных моделей в задачах прогнозирования доходностей структурных нот

Александр Гришканич, Исполнительный директор департамента аналитики и внедрения технологий

Газпромбанк

16.00 Перерыв на кофе

16.30

Система управление рисками по операциям на финансовых рынках: опыт Сбербанк страхование жизни

Андрей Бурмистров, Директор по рискам СК «Сбербанк страхования жизни»

- Построение контрольной среды по операциям на финансовых рынках
- Направления и инструменты контроля
- Эволюция цифровизации контрольных процедур
- Примеры реализованных проектов по контролю портфелей в один миллиард и один триллион рублей
- Вопросы и ответы

17.00

Обзор практики учета климатических рисков в деятельности кредитных организаций

Максим Богач, Руководитель Службы управления рисками

Эм-Ю-Эф-Джи Банк (Евразия)

- Куда лучше «вкрутить» учет климатических рисков?
- Как на деле, а не на словах учесть влияние?
- Какие ожидания по внедрению в локальном регулировании?
- Вопросы и ответы

17.30

Сведения для предотвращения возможного мошенничества в кредитных историях

Владимир Шикин, заместитель директора по маркетингу

НБКИ

- Цели, задачи и принципы формирования сведений для предотвращения возможного мошенничества в кредитных историях;
- Решение регуляторных и бизнес задач кредитора с помощью сведений для предотвращения возможного мошенничества
- Вопросы и ответы

18.00

Заключительное слово модератора и закрытие конференции

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В БАНКОВСКОМ СЕКТОРЕ

24-25 марта 2026 года, Сафмар Тверская Москва

Стоимость участия в конференции в качестве слушателей:

	Регистрация до 31.01.2026 г.	Регистрация после 31.01.2026 г.
Оплата в течение 30 дней с даты регистрации	89 250 руб., в т.ч. НДС 5%	96 600 руб., в т.ч. НДС 5%
Оплата после проведения конференции	100 800 руб., в т.ч. НДС 5%	103 950 руб., в т.ч. НДС 5%
Приобретение презентаций конференции без посещения мероприятия 28 350 руб., в т.ч. НДС 5%		

ПРОСТЫЕ СПОСОБЫ РЕГИСТРАЦИИ



+7 495 649 84 14



info@dialogmanag.com



www.dialogmanag.com

ФИО

Должность

Руководитель

Компания

Телефон с кодом страны

Эл. Почта

Формат участия: Очный/Онлайн

Дата

Компания Dialog Management оставляет за собой право изменить программу, слоты и докладчиков без предварительного уведомления.

СПОНСОРСКИЕ ВОЗМОЖНОСТИ:

Предлагаем Вам рассмотреть возможность участия в конференции в качестве спонсора мероприятия, что позволит Вам получить площадку для делового общения с целевой аудиторией, установления новых и поддержания прежних контактов с партнерами. Конференция предоставит Вам уникальную возможность еще раз заявить о своем присутствии на рынке широкому кругу предприятий и организаций и, соответственно, найти новых клиентов и партнеров.