

# Tržna tveganja in načini za njihovo zavarovanje

Tržna tveganja so ena od najbolj raziskanih, a hkrati tudi zelo pomembnih elementov finančnih tveganj. Banke in tudi podjetja sprejemajo vse več tržnih tveganj z namenom izboljšanja svoje učinkovitosti. Že od začetka finančne krize pa so organizacije tudi vedno bolj osredotočene na upravljanje teh tveganj. Njihovi obravnavi in zavarovanju namenjajo vse več časa in sredstev.

## Cilj delavnice

Na delavnici želimo udeležence seznaniti z okvirjem, ki ga lahko uporabljajo finančne institucije, institucionalni vlagatelji in podjetja za prepoznavanje, merjenje in poročanje tržnih tveganj. Predstavljen bo podroben pregled upravljanja tržnih tveganj, vključno z merjenjem tveganj, sistemom limitov, politik in ključnih kontrol. Po razpravi o posameznih tržnih tveganjih bodo podrobneje predstavljeni tudi instrumenti in metode, ki se uporabljajo za upravljanje posameznih tveganj.

## Način dela

Delavnica je sestavljena iz teorije upravljanja tržnih tveganj, razprav, kratkih primerov in vaj. Primerna je tudi za tiste, ki se s tržnim tveganjem vsakodnevno ukvarjajo in bi radi dopolnili svoje znanje z dodatnimi primeri iz prakse.

Ob koncu delavnice bodo udeleženci usposobljeni obravnavati in ocenjevati različna tržna tveganja, pa tudi izvesti potrebne omejitve in kontrole.

Udeleženci bodo po seminarju bolje razumeli različne vrste tržnih tveganj, ki so prisotna na finančnih trgih, pa tudi postopke in omejitve, ki so potrebni za učinkovito upravljanje z njimi.

## Vsebina delavnice

- Uvod v tržna tveganja
- Kategorije tržnega tveganja
  - valutno tveganje
  - obrestno tveganje
  - tveganje cen delnic
  - tveganje cen surovin
- Volatilnost
- Vpliv diverzifikacije na portfelj
- Tveganje in strpnost do tveganja
- Obvladovanje tveganj pri valutnem trgovanju
- Obvladovanje tveganj na denarnem trgu
- Obvladovanje tveganj pri poslovanju z obveznicami
- Obvladovanje tveganja pri poslovanju z delnicami
- Obvladovanje tveganj pri poslovanju iz izvedenimi finančnimi instrumenti
- Limiti in proces kontrol
- Kultura in struktura organizacije
- Uvod v koncept tvegane vrednosti (Value at Risk - VaR)

**Izvajalec: Jernej Doles**

**Datum: 24. marec 2020**

**Kraj izvedbe: Ljubljana, Four Points by Sheraton Ljubljana Mons**



## Delavnica je namenjena:

- strokovnim delavcem s področja upravljanja s tveganji,
- zakladnikom v bankah in podjetjih, ki so vsakodnevno soočeni s tržnimi tveganji pri svojem poslovanju ali pri uporabi različnih strategij financiranja,
- skrbnikom podjetij in komercialistom, ki ponujajo različne bančne produkte in morajo pri svojem delu svetovati podjetjem glede tržnih tveganj in uporabe najprimernejših rešitev za upravljanje z njimi,
- trgovcem s finančnimi instrumenti,
- borznim posrednikom,
- upravljavcem skladov,
- zaposlenim v računovodstvu in reviziji,
- osebju v spremljavi trgovanja,
- osebju regulativnega poročanja,
- drugim bančnim uslužbencem, ki jih zanimajo metode obvladovanja tržnih tveganj.

## Tržna tveganja in načini za njihovo zavarovanje

Datum: 24. marec 2020

Izvajalec: Jernej Doles

\* Življenjepis predavatelja najdete na spletni strani  
<https://www.omegafinance.si/blog/jernej-doles/>



Kraj izvedbe: Ljubljana, Four Points by Sheraton Ljubljana Mons

## Urnik delavnice

9.00–10.30	Uvod v tržna tveganja <ul style="list-style-type: none"> <li>splošna opredelitev tveganja</li> <li>razlogi za upravljanje tveganj</li> </ul> Tržno tveganje Upravljanje tveganja na denarnem trgu	13.30–15.00	Upravljanje tržnega tveganja pri poslovanju s tujimi valutami in izvedenimi finančnimi instrumenti Limiti in proces kontrol
10.30–10.45	Odmor	15.00–15.15	Odmor
10.45–12.30	Upravljanje tržnega tveganja pri poslovanju z obveznicami in delnicami	15.15–16.00	Metode za merjenje tržnega tveganja <ul style="list-style-type: none"> <li>nestanovitnost</li> <li>Value at Risk (Var)</li> </ul> Zaključek seminarja
12.30–13.30	Odmor za kosilo	16.00	

**Na delavnici bodo obravnavani zanimivi in aktualni primeri iz prakse upravljanja tržnih tveganj.**

## Prijavnica

Prijavljam se na seminar **Tržna tveganja in načini za njihovo zavarovanje**, ki bo 24. marca 2020 v hotelu Four Points by Sheraton Ljubljana Mons.

### Podatki o slušatelju

Ime in priimek: \_\_\_\_\_

Delovno mesto oz. področje dela: \_\_\_\_\_

Organizacija: \_\_\_\_\_

Naslov: \_\_\_\_\_

Poštna št. in pošta: \_\_\_\_\_

E-pošta: \_\_\_\_\_

Tel.: \_\_\_\_\_

Podpis \_\_\_\_\_ Datum \_\_\_\_\_

### Kotizacija: 305 EUR

Podjetje Omega Finance d.o.o. ni zavezanec za DDV.

Kotizacija vključuje učno gradivo, kosilo in pogostitve med odmori. Parkiranje je brezplačno na parkirišču hotela.

Prijave sprejemamo do 10. 3. 2020.

Elektronsko prijavo na delavnico najdete na internetni strani

<https://www.omegafinance.si/blog/shop/ljubljana/trzna-tveganja/>

Račun vam bomo poslali po prejemu izpolnjene prijavnice.

Plačilo kotizacije moramo prejeti pred začetkom seminarja.

### Podatki o sponzorju

Želim, da registrirate na levi strani navedenega slušatelja

Ime in priimek: \_\_\_\_\_

Delovno mesto oz. področje dela: \_\_\_\_\_

Podpis \_\_\_\_\_ Datum \_\_\_\_\_

Omega Finance, izobraževanje in svetovanje, d.o.o., Mivka 28, SI-1000 Ljubljana, Slovenija



#### Informacije

Kotizacija vključuje predstavitev, učno gradivo, kosilo in pogostitve med odmori. Račun za kotizacijo vam bomo poslali po prejemu prijavnice. Plačilo računa mora biti izvršeno pred začetkom seminarja.

#### Varovanje podatkov

Vse informacije, ki jih boste za namen ali v času delavnice izmenjevali ali nam jih posredovali, bodo varovane v našem podjetju. Te podatke lahko Omega Finance, d.o.o., uporabi za informiranje o prihodnjih seminarjih in delavnicah.

#### Omejitev odgovornosti

Omega Finance, d.o.o., si pridržuje vse pravice, da spremeni ali odpove katerikoli del ali odpove celoten objavljen program zaradi nepredvidljivih dogodkov. Pridržuje si tudi pravico, da v primeru premajhnega ali prevelikega števila udeležencev spremeni lokacijo izvedbe seminarja.

O vseh spremembah vas mora obvestiti najmanj 3 dni pred začetkom seminarja.

#### Odjava

Odjava že prijavljenega slušatelja mora biti pisna (po e-pošti, pošti ali faksu) in mora prispeti na naslov podjetja najmanj 5 dni pred pričetkom seminarja. Slušatelji, ki se bodo odjavili po tem roku, niso upravičeni do vračila plačane kotizacije, lahko pa prenesejo plačilo na katerikoli drugi seminar v prihodnosti, pri čemer jim bo izstavljen račun za zgolj 10 % kotizacije novega seminarja. Prenos kotizacije je mogoč samo enkrat. »Nadomestni seminar« mora biti v roku 6 mesecev. Seveda pa lahko družba prijavi tudi nadomestnoega slušatelja.

#### Popust za skupine

2 udeleženca  
270 EUR / udeleženca

3 in več udeležencev  
250 EUR / udeleženca