



الاتحاد الدولي للمصرفيين العرب
World Union of Arab Bankers



PREPARE TO PREVAIL (P2P): Comprehensive Risk and Capital Solutions

GRAND HYATT HOTEL  AMMAN

10 - 11
JULY 2024
JORDAN

WUAB ANNUAL SPONSORS 2024

بنك القاهرة
Banque du Caire

بنك مصر
BANQUE MISR

الائتماد اللبناني
CREDIT LIBANAIS

KIB
BANK FOR LIFE

بنك كاك الدولي
International Bank

بوكامسن
BUKHAMSEEN HOLDING

مصرف الجمهورية
JUMHOURIA BANK

PREPARE TO PREVAIL (P2P)

Comprehensive Risk and Capital Solutions

OVERVIEW

The World Union of Arab Bankers (WUAB) proudly presents "Prepare to Prevail (P2P) - Comprehensive Risk and Capital Solutions," a forum designed for banking professionals to tackle the challenges of today's financial environment. This forum delivers essential insights into capital reporting, stress testing, and scenario analysis, with a focus on understanding the banking business model, analyzing capital consumption trends, and developing rigorous stress test scenarios tailored to both banks and countries.

Participants will gain a profound understanding of the CAMEL approach, exploring its critical components: Capital Adequacy, Asset Quality, Management, Earnings, Liquidity, and Interest Rate Risk. By learning advanced scoring methodologies and benchmarking against best practices, attendees will be equipped to leverage CAMEL ratings for strategic decision-making and performance enhancement, ensuring their institutions meet and exceed regulatory requirements.

The forum will also cover the Risk-Adjusted Return on Capital (RAROC) framework, offering a clear, step-by-step guide to measuring RAROC at the borrower and business line levels. Participants will address governance and data challenges, designating a RAROC champion within their institutions to ensure seamless implementation. By integrating RAROC into risk-based pricing and capital allocation decisions, banks can enhance profitability and align their business models with risk management best practices.

This forum promises to equip banking professionals with the practical knowledge and tools necessary to master the complexities of the modern financial landscape.

Join us at "Prepare to Prevail (P2P) - Comprehensive Risk and Capital Solutions" to stay ahead of industry trends, ensure compliance, and drive your institution's success in a competitive market.



PREPARE TO PREVAIL (P2P)

Comprehensive Risk and Capital Solutions

TOPICS OF DISCUSSION

Capital Reporting, Stress Testing and Scenario Analysis

- Understanding the bank business model (balance sheet and capital)
- Analysis of the major sources of capital consumption; trend analysis; peer analysis
- Discuss availability of macroeconomic models and regulatory stress testing scenarios
- Develop plausible and severe bank specific and country specific scenarios for capital stress test and measure impact on the bank's operations
- Discuss banks' choices and limitations

Risk Assessment and Reporting Using CAMEL Approach: A Deep Dive... Beyond Regulatory Requirement

- A Practical Analysis of CAMEL Components: Capital Adequacy, Asset Quality, Management, Earnings, Liquidity, and Interest Rate Risk
- Scoring Methodology and Benchmarking Against Best Practices
- Utilizing CAMEL Ratings for Strategic Decision Making and Performance Improvement

Risk-Adjusted Return on Capital (RAROC) Framework

- Understanding the bank business model, balance sheet and income statement
- Demystifying risk-based profitability: A Step-by-Step Simple Guide to measure RAROC at a borrower and business line level
- Overcoming Governance and Data Challenges (Designated RAROC Champion)
- Integrating RAROC into Risk-Based Pricing and Capital Allocation Decisions
- Case Studies on RAROC Implementation and its Impact on Bank Profitability and Business Model

FRS Liquidity Risk Management

- Advanced Metrics for Measuring Liquidity Risk: LCR, NSFR, and Beyond
- Real-Time Liquidity Monitoring Systems and Technologies
- Designing and Implementing Contingency Funding Plans

Interest Rate Risk in the Banking Book (IRRBB)

- Quantitative Techniques for Measuring Interest Rate Risk: Gap Analysis, Duration, and Value at Risk (VaR)
- Interest Rate Derivatives as Hedging Tools: Swaps, Options, and Futures
- Impact Assessment of Interest Rate Shocks on Earnings and Economic Value

PREPARE TO PREVAIL (P2P)

Comprehensive Risk and Capital Solutions

WHO SHOULD ATTEND

- Bank Executives and Senior Management
- Chief Risk Officers (CROs)
- Risk Management Professionals
- Compliance Officers
- Regulatory Affairs Specialists
- Financial Analysts
- Capital Management Experts
- Internal Auditors
- Credit Risk Managers
- Market Risk Managers
- Operational Risk Managers
- Liquidity Risk Managers
- Asset and Liability Management (ALM) Professionals
- Treasury Professionals
- Strategic Planners
- Financial Controllers
- Investment Banking Professionals
- IT and Data Management Specialists in Banking
- Policy Makers and Regulators in the Banking Sector





الاتحاد الدولي للمصرفيين العرب
World Union of Arab Bankers



نستعد اليوم لند صد غدًا

حلول شاملة للمخاطر ورأس المال

فندق جراند حياة عمان

10 - 11

تموز/يوليو 2024

الأردن

WUAB ANNUAL SPONSORS 2024

بنك القاهرة
Banque du Caire

بنك مصر
BANQUE MISR

الائتماد اللبناني
CREDIT LIBANAIB

KIB
BANK FOR LIFE

بنك كاك الدولي
International Bank

بوكامسن
BUKHAMSEEN HOLDING

مصرف الجمهورية
JUMHOURIA BANK

نستعد اليوم، لنحصد غدًا حلول شاملة للمخاطر ورأس المال

الخلفية

ينظم الاتحاد الدولي للمصرفيين العرب لقاء بعنوان 'نستعد اليوم، لنحصد غدًا' - حلول شاملة للمخاطر ورأس المال، الذي يهدف إلى تزويد المتخصصين في القطاع المصرفي بالأدوات اللازمة لمواجهة التحديات المصرفية. يركز هذا اللقاء على تقديم رؤى معمقة حول تقارير رأس المال، واختبارات الضغط، وتحليل السيناريوهات، مع تسليط الضوء على فهم نماذج الأعمال المصرفية، وتحليل اتجاهات استهلاك رأس المال، وتطوير سيناريوهات اختبارات الضغط المصممة خصيصًا لتلبية احتياجات المصارف والدول.

سيكتسب المشاركون فهماً معمقاً لمنهجية CAMEL من خلال استعراض مكوناتها الأساسية: كفاية رأس المال، جودة الأصول، الإدارة، الأرباح، السيولة، ومخاطر سعر الفائدة. من خلال تعلم أساليب تقييم متقدمة ومقارنتها بأفضل الممارسات، سيتمكن المشاركون من استخدام تقييمات CAMEL لاتخاذ قرارات استراتيجية تعزز الأداء وتضمن التزام مؤسساتهم بالمتطلبات التنظيمية.

سيشمل اللقاء أيضًا مناقشة إطار العمل للعائد على رأس المال المعدل بالمخاطر (RAROC)، حيث سيتم تقديم دليل شامل لقياس RAROC على مستوى الأفراد وأقسام الأعمال المختلفة. سيبحث المشاركون في التحديات المتعلقة بالحوكمة والبيانات، مع تعيين متخصص في RAROC داخل مؤسساتهم لضمان تطبيقها بنجاح. من خلال دمج RAROC في تسعير المخاطر وقرارات تخصيص رأس المال، يمكن البنوك من تعزيز ربحيتها ومواءمة نماذج أعمالها مع أفضل ممارسات إدارة المخاطر.

يهدف اللقاء إلى تزويد المشاركين بالمعرفة العملية والأدوات الضرورية لفهم وتجاوز تعقيدات القطاع المصرفي بنجاح.

يسرنا دعوتكم للانضمام إلى اللقاء 'نستعد اليوم، لنحصد غدًا' - حلول شاملة للمخاطر ورأس المال لتكونوا على اطلاع بأحدث التوجهات، وضمان الامتثال للمعايير، وتعزيز نجاح مؤسساتكم في سوق مليئة بالتحديات.



نستعد اليوم، لنحصد غدًا

حلول شاملة للمخاطر ورأس المال

المواضيع

تقارير رأس المال، اختبارات الضغط وتحليل السيناريوهات

- فهم نموذج أعمال المصرف (الميزانية العمومية ورأس المال)
- تحليل المصادر الرئيسية لاستهلاك رأس المال؛ تحليل الاتجاهات؛ مقارنة الأداء مع المصارف المماثلة
- مناقشة توافر النماذج الاقتصادية الكلية وسيناريوهات اختبارات الضغط التنظيمية
- تطوير سيناريوهات محددة وشاملة للمصارف والدول لاختبار الضغط على رأس المال وقياس تأثيرها على عمليات المصرف
- مناقشة الخيارات المتاحة والقيود التي تواجه المصارف

تقييم وإعداد تقارير المخاطر باستخدام منهجية: CAMEL تحليل معمق يتجاوز المتطلبات التنظيمية

- تحليل عملي لمكونات: CAMEL كفاية رأس المال، جودة الأصول، الإدارة، الأرباح، السيولة، ومخاطر سعر الفائدة
- منهجية تقييم وتصنيف مكونات CAMEL ومقارنتها بأفضل الممارسات
- استخدام تصنيفات CAMEL في اتخاذ القرارات الاستراتيجية وتحسين الأداء المصرفي

إطار العمل للعائد المعدل حسب المخاطر على رأس المال (RAROC)

- فهم نموذج عمل المصرف بما في ذلك الميزانية العمومية وبيان الدخل
- تبسيط مفهوم الربحية المبنية على المخاطر: دليل عملي لقياس RAROC على مستوى المفترض وخط الأعمال
- التغلب على تحديات الحوكمة وإدارة البيانات (تعيين مسؤول عن RAROC)
- دمج RAROC في قرارات تسعير المخاطر وتخصيص رأس المال
- دراسات حالة عن تنفيذ RAROC وتأثيره على ربحية المصرف ونموذج الأعمال المعتمد

إدارة مخاطر السيولة وفقاً لمتطلبات النظام المالي

- مقاييس متقدمة لتقييم مخاطر السيولة: نسبة تغطية السيولة (LCR)، نسبة التمويل المستقر (NSFR)
- أنظمة وتكنولوجيا مراقبة السيولة في الوقت الفعلي
- تصميم وتنفيذ خطط التمويل الطارئة

مخاطر أسعار الفائدة في محفظة المصرف (IRRBB)

- الأساليب الكمية لقياس مخاطر أسعار الفائدة: تحليل الفجوات، حساب المدة الزمنية، وتقدير قيمة المخاطر
- استخدام المشتقات المالية كأدوات للتحوط ضد مخاطر أسعار الفائدة: المبادلات المالية، الخيارات المالية، والعقود الآجلة
- تقييم تأثير تقلبات أسعار الفائدة على الأرباح والقيمة الاقتصادية للمصرف

نستعد اليوم، لنحصد غدًا حلول شاملة للمخاطر ورأس المال

الجمهور المستهدف

- المديرين التنفيذيين والإداريين الكبار في البنوك
- رؤساء إدارة المخاطر
- متخصصو إدارة المخاطر
- مسؤولو الامتثال
- خبراء الشؤون التنظيمية
- خبراء إدارة رأس المال
- المدققون الداخليون
- مديرو مخاطر الائتمان
- مديرو مخاطر السوق
- مديرو المخاطر التشغيلية
- مديرو مخاطر السيولة
- متخصصو إدارة الأصول
- خبراء الخزائنة
- المخططون الاستراتيجيون
- متخصصو المصرفية الاستثمارية
- متخصصو تكنولوجيا المعلومات وإدارة البيانات في المصارف
- صناع السياسات والمنظمون في القطاع المصرفي

