



INŠTITÚT BANKOVÉHO
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

INŠTITÚT BANKOVÉHO VZDELÁVANIA NBS, n.o.

Pozvánka na seminár

CREDIT VALUATION ADJUSTMENT

Bratislava

19. – 20. jún 2018

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.
je certifikovaný podľa európskej normy
systému manažérstva kvality

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.
je členom European Banking and Financial
Services Training Association



CREDIT VALUATION ADJUSTMENT

ÚČASTNÍCI:

Seminár je vhodný najmä pre risk manažérov, špecialistov kreditného rizika, pracovníkov zodpovedných za compliance, právnikov a interných audítorov.

CIEĽ:

Na seminári sa účastníci oboznámia s aktuálnym konceptom Credit Valuation Adjustment (CVA), s jeho teoretickými základmi a s premietnutím do aktuálnej podoby bankovej regulácie. Využitie v praxi bude prezentované na konkrétnych príkladoch.

OBSAH SEMINÁRA:

- **úvod**
 - kreditné riziko protistrany (CCR)
 - čo je to Credit Valuation Adjustment (CVA)?
 - finančná kríza
 - regulácia – Basel II, Basel III, Dodd-Frank
 - výpočet CVA
 - riziko CVA
 - riadenie CCR a rizika CVA
 - literatúra
 - skratky a niektoré pojmy
 - matematické a štatistické minimum
- **modely a oceňovanie kreditného rizika**
 - základné pojmy kreditného rizika – čas defaultu, PD, pravdepodobnosť prežitia, hazard rate, intenzita defaultu, EAD, recovery rate a LGD
 - skutočná PD versus rizikové – neutrálne PD
 - oceňovanie finančných nástrojov s kreditným rizikom
 - kreditný spread
 - modely kreditného rizika – redukované versus štrukturálne
- **kreditné riziko protistrany (CCR)**
 - CCR – dôležité riziko OTC derivátových transakcií
 - príklady CCR
 - finančná kríza – Bear Stearns, Lehman Brothers, AIG
 - prehľad metód merania a riadenia CCR
 - prístup Basel II k CCR
 - regulátorne zmeny v dôsledku finančnej krízy
 - súčasná prax vo finančných inštitúciách

- **expozícia voči protistrane**
 - výška budúcej expozície ako náhodná veličina
 - miery budúcej expozície – PFE, EE, EPE, EEE, EEPE
 - budúca expozícia pre štandardné OTC deriváty
 - netting
 - kolaterál
- **koncept CVA**
 - definícia CVA
 - vzorce pre CVA:
 - Wrong – way risk, Right – way risk
 - bilaterálne CVA
 - zahrnutie CVA do transakcií
 - riziko CVA
- **výpočet CVA**
 - praktické problémy s výpočtom CVA
 - CVA pre rôzne OTC deriváty:
 - Úrokové – FRA, IRS
 - Menové – FX forwardy, opcie, swapy
 - Akciové – opcie
 - Krediné – CDS
 - parametre pre výpočet CVA
 - úlohy kolerácií – wrong way risk, koleterál
 - numerické aproximácie
 - Monte – Carlo simulácia
- **meranie CCR a rizika CVA**
 - straty v dôsledku defaultu protistrany a MtM straty
 - volatilita CVA a CVA VaR
 - praktické aspekty výpočtu CVA VaR
 - CCR na úrovni portfólia
- **zhrnutie seminára a záver**

LEKTOR: **Mgr. Ing. Václav Novotný**, odborník na danú problematiku z českej konzultačnej spoločnosti Advanced Risk Management, s.r.o. Od roku 1999 je konateľom a riaditeľom tejto spoločnosti. Špecializuje sa na posudzovanie kvality procesov a postupov, na posudzovanie kvalitatívnych požiadaviek na modely merania a riadenia rizík a pod.. Vyštudoval Matematicko-fyzikálnu fakultu Karlovej univerzity a Fakultu financií a účtovníctva na Vysokej škole ekonomickej v Prahe.

ORGANIZAČNÉ POKYNY

TERMÍN KONANIA:

19. - 20. jún 2018

MIESTO KONANIA:

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.
Tomášikova 5238/28A
821 01 Bratislava - Ružinov

GARANT PODUJATIA:

Ing. Monika Kováčsová
☎ 02/5787 3538
fax: 02/4363 9314
e-mail: monika.kovacsova@nbs.sk

ČASOVÝ HARMONOGRAM:

prezentácia:

8.45 h – 9.00 h

vyučovanie:

9.00 h – 16.00 h

ÚČASTNÍCKY POPLATOK vrátane občerstvenia:

na 1 účastníka bez DPH

700,00 EUR

na 1 účastníka vrátane DPH

840,00 EUR

KONTAKTNÉ ÚDAJE IBV NBS, N.O.:

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.
Tomášikova 5238/28A
821 01 Bratislava - Ružinov
IČO: 42166373
DIČ: 2022730369
IČ DPH: SK 2022730369

BANKOVÉ SPOJENIE:

Číslo účtu IBV: **74069/0720**
IBAN: **SK08 0720 0000 0000 0007 4069**
SWIFT: **NBSB SKBX**
Variabilný symbol: **1615**
Konštantný symbol: **0308**

ÚHRADA ÚČASTNÍCKEHO POPLATKU:

Účastnícky poplatok je potrebné uhradiť do termínu uzávierky t. j. **4. júna 2018.**

Účastnícky poplatok nie je možné uhrádzať poštovým peňažným poukazom.

Potvrdenie o úhrade (výpis z účtu alebo z internetbankingu) zašlite e-mailom na adresu monika.kovacsova@nbs.sk alebo sa ním preukážete pred začiatkom seminára.

PODMIENKY ZRUŠENIA ÚČASTI / ZMENY:

Písomne, najneskôr **5 pracovných dní** pred začiatkom podujatia.

Dovoľujeme si Vás upozorniť, že v prípade nestornovanej záväznej prihlášky si IBV NBS, n.o. vyhradzuje právo vyfakturovať účastnícky poplatok a náklady na objednanú stravu v plnej výške. Zastúpenie účastníka je možné.

Bližšie informácie o podmienkach sa nachádzajú vo Všeobecných obchodných podmienkach na: <http://www.ibv-nbs.sk/O-nas/VOP>.

DOPRAVA NA MIESTO KONANIA SEMINÁRA A MIESTO UBYTOVANIA (TOMÁŠIKOVA 5238/28A):

Mestskou hromadnou dopravou

z AS Mlynské Nivy: autobus č. 50, vystúpiť na zastávke na znamenie VD Úsvit
z hlavnej železničnej stanice: autobusom č. 61, zastávka Trnavská, s prípadným prestupom na autobus č. 50, vystúpiť na zastávke na znamenie Haburská

Bližšie informácie o doprave: <http://www.imhd.sk/ba>

Autom: **Bezplatné parkovanie** je možné v mieste konania podľa kapacitných možností.

UBYTOVANIE: <http://www.ibv-nbs.sk/Dalsie-sluzby/Ubytovanie>

Vyplnené a potvrdené záväzné prihlášky zasielajte na adresu: monika.kovacsova@nbs.sk

alebo prostredníctvom on-line formulára na stránke: www.ibv-nbs.sk

najneskôr do 4. júna 2018

Dovoľujeme si Vás upozorniť, že účastníci, ktorí nie sú zamestnancami NBS, sú povinní preukázať sa pri vstupe do budovy platným občianskym preukazom.

Kompletnú ponuku vzdelávacích podujatí Inštitútu bankového vzdelávania NBS, n.o. nájdete na internetovej adrese <http://www.ibv-nbs.sk>

Tešíme sa na stretnutie s Vami.

doc. Ing. Peter Szovics, PhD.
riaditeľ
Inštitút bankového vzdelávania NBS, n. o.

Z á v ä z n á p r i h l á š k a

Názov podujatia:

Termín konania:.....

Názov organizácie pre fakturáciu:

Adresa organizácie:

PSČ organizácie:

IČ DPH: IČO:.....

Závazne prihlasujeme:

Meno:.....Priezvisko:.....Titul:.....

Dĺžka bankovej praxe:

Presná adresa pracoviska:.....

.....PSČ:

Útvar:

Telefón:

Fax:..... E-mail:

Odborné zameranie:

Objednávka ubytovania: od do
spolu: nocľahov

Závaznú prihlášku je možné **stornovať písomne v termíne, ktorý je uvedený v pozvánke** na vzdelávacie podujatie. Zastúpenie účastníka je možné. V prípade nestornovanej záväznej prihlášky si IBV vyhradzuje právo vyfakturovať účastnícky poplatok a náklady na objednanú stravu v plnej výške.

V..... dňa

.....
pečiatka a podpis zástupcu vysielajúcej organizácie

SM 03 02 1/6

V zmysle zákona č. 122/2013 Z.z. o ochrane osobných údajov v znení neskorších predpisov, týmto udeľujem Inštitútu bankového vzdelávania NBS, n.o. súhlas k správe, spracovávaniu a uchovávaní mojich osobných údajov v rozsahu nevyhnutnom pre potreby súvisiace s účasťou na vzdelávacích podujatiach, ktoré organizuje, ako aj s vydaním príslušného dokladu o ich absolvovaní a evidenciou o ich absolvovaní.