



INŠTITÚT BANKOVÉHO  
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

**INŠTITÚT BANKOVÉHO VZDELÁVANIA NBS, n.o.**

**Pozvánka na seminár**

# **PRÍPRAVA NA SREP ALEBO DOHĽAD V PRAXI**

**Bratislava  
25. september 2019**

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



# **PRÍPRAVA NA SREP ALEBO DOHĽAD V PRAXI**

## **ÚČASTNÍCI:**

Seminár je vhodný najmä pre pracovníkov útvaru riadenia rizík, compliance a interného auditu.

## **CIEĽ:**

Seminár poskytuje komplexnú informáciu o jednotlivých prvkoch procesu SREP (Supervisory Review and Evaluation Process) od kategorizácie inštitúcií cez hodnotenie jednotlivých oblastí SREPU až po výstup vo forme rozhodnutia o požadovanej výške kapitálu a likvidity. Ďalej budú diskutované požiadavky na ICAAP (Internal Capital Adequacy Assessment Process) a ILAAP (Internal Liquidity Adequacy Assessment Process) a overovanie formou dohľadu na mieste.

## **OBSAH SEMINÁRA:**

### **ÚVOD DO SREP PROCESU**

- Štruktúra Basel II/III
- Štruktúra SREP

### **HLAVNÉ PRVKY SREP PROCESU**

- Kategorizácia inštitúcií a proporcionalita
- Skóring v procese SREP
- Monitoring kľúčových indikátorov
- Analýza obchodného modelu
  - o Predbežné hodnotenie
  - o Hodnotenie obchodného prostredia
  - o Analýza aktuálneho obchodného modelu
  - o Analýza stratégie a finančných plánov
  - o Hodnotenie životaschopnosti obchodného modelu
  - o Hodnotenie udržateľnosti stratégie
- Hodnotenie riadiaceho a kontrolného systému
  - o Organizácia a činnosť orgánov
  - o Odmeňovanie
  - o Systém riadenia rizík
  - o Kontrolný systém
- Hodnotenie rizík pre kapitál
  - o Kreditné riziko
  - o Trhové riziká

- Operačné riziko
- IRRBB
- Hodnotenie primeranosti kapitálu inštitúcie
  - Určenie dodatočných kapitálových požiadaviek
- Hodnotenie rizík pre likviditu a financovanie
  - Hodnotenie rizika likvidity
  - Hodnotenie rizika financovania
- Hodnotenie primeranosti likvidity inštitúcie
  - Celkové hodnotenie likvidity
  - Určenie požiadaviek na likviditu
- Celkové SREP hodnotenie a opatrenia dohľadu

### **POŽIADAVKY NA RIADIACI A KONTROLNÝ SYSTÉM**

- Úvod
- Koncept troch línií obrany
- Role a zodpovednosti orgánov a výborov
  - Kontrolný orgán
  - Riadiaci orgán
  - CEO
  - Výbory
- Organizačná štruktúra
- Outsourcing
- Risk culture a business conduct
- Systém vnútornej kontroly
  - Organizácia
  - Nezávislosť
  - Funkcie riadenia rizík
  - Funkcie compliance
  - Funkcie interného auditu

### **POŽIADAVKY NA ICAAP A ILAAP**

- Úvod do ICAAP a ILAAP
- Spoločné požiadavky na ICAAP a ILAAP
  - Model podnikania a stratégie
  - Riadiaci a kontrolný systém
  - Rizikový apetít
  - Stresové testovanie
  - Dáta pre riadenie rizík a IT systémy
- Požiadavky na ICAAP
  - Celkový rámec
  - Meranie, hodnotenie a agregácia rizík
  - Interný kapitál a jeho alokácia
  - Plánovanie kapitálu
  - Stresové testovanie
- Požiadavky na ILAAP
  - Celkový rámec
  - Stratégia financovania
  - Vankúše likvidity a kolaterál management

- Alokácia nákladov a výnosov
- Intra-day riadenie likvidity
- Stresové testovanie
- Pohotovostné plány
- Interná validácia ICAAP a ILAAP
- Role interného auditu v ICAAP a ILAAP

#### **KONTROLY V BANKÁCH**

- Koncepcie a zásady dohľadu
- Cyklus dohľadu
- Kontroly na mieste
- Krízové riadenie
- Dohľad ECB

#### **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

|                          |   |
|--------------------------|---|
| <b>TERMÍN KONANIA:</b>   | <b>25. september 2019</b>   |
| <b>MIESTO KONANIA:</b>   | Bratislava  |
| <b>GARANT PODUJATIA:</b> | Ing. Monika Kováčsová<br>☎ +421 915 720 043<br>e-mail: <a href="mailto:monika.kovacsova@nbs.sk">monika.kovacsova@nbs.sk</a> |

### ČASOVÝ HARMONOGRAM:

|              |                          |
|--------------|--------------------------|
| prezentácia: | <b>08:45 h – 09.00 h</b> |
| vyučovanie:  | <b>09:00 h – 16.00 h</b> |

### ÚČASTNÍCKY POPLATOK:

|                            |                   |
|----------------------------|-------------------|
| na 1 účastníka bez DPH     | <b>379,00 EUR</b> |
| na 1 účastníka vrátane DPH | <b>454,80 EUR</b> |

### KONTAKTNÉ ÚDAJE IBV NBS, N.O.:

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.  
Drieňová 1081/31  
821 01 Bratislava - Ružinov  
IČO: 42166373  
DIČ: 2022730369  
IČ DPH: SK 2022730369

|                          |                           |                                      |
|--------------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| <b>BANKOVÉ SPOJENIE:</b> | <b>Číslo účtu IBV:</b>    | <b>74069/0720</b>                    |
|                          | <b>IBAN:</b>              | <b>SK08 0720 0000 0000 0007 4069</b> |
|                          | <b>SWIFT:</b>             | <b>NBSB SKBX</b>                     |
|                          | <b>Variabilný symbol:</b> | <b>1896</b>                          |
|                          | <b>Konštantný symbol:</b> | <b>0308</b>                          |

Účastnícky poplatok je potrebné uhradiť do termínu uzávierky t.j. **8. septembra 2019**. 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](mailto:monika.kovacsova@nbs.sk) alebo sa ním preukážete pred začiatkom seminára.

### PODMIENKY ZRUŠENIA ÚČASTI / ZMENY:

Závaznú prihlášku je možné stornovať a zmeny v objednaných službách sú možné iba písomne, najneskôr 5 pracovných dní pred začiatkom podujatia. 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 (BUDOVA DOPRASTAVU, DRIEŇOVÁ 31):**



**Mestskou hromadnou dopravou:**

- zastávka „Solivarská“, spoje 66, 78
- zastávka „Maximiliána Hella“, spoje 50, 66, 78, 96, 196
- zastávka „Zálužická“, spoj 50

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

**Autom:** Parkovanie v okolí.

Vyplnené a potvrdené záväzné prihlášky zasielajte na adresu: [monika.kovacsova@nbs.sk](mailto:monika.kovacsova@nbs.sk)

alebo prostredníctvom on-line formulára na stránke: [www.ibv-nbs.sk](http://www.ibv-nbs.sk)

**najneskôr do 8. septembra 2019**

**Dovoľujeme si Vás upozorniť, že účastníci 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: .....

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.

V..... dňa .....

.....

pečiatka a podpis zástupcu vysielajúcej organizácie

Súhlasím so Všeobecnými obchodnými podmienkami, dostupné na webovej stránke:

[http://ibv-nbs.sk/docs/VOP\\_IBV\\_2018\\_v1.2.pdf](http://ibv-nbs.sk/docs/VOP_IBV_2018_v1.2.pdf)

Súhlasím  Nesúhlasím so spracúvaním mojich osobných údajov uvedených v registračnom formulári, a to na účel zasielania informačných emailov na podujatia organizované spoločnosťou Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.