



INŠTITÚT BANKOVÉHO
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

Pozvánka na online workshop

ALM

RIADENIE ÚROKOVÉHO RIZIKA

3. december 2020

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

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



*Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.
Vás pozýva na online workshop*

ALM – RIADENIE ÚROKOVÉHO RIZIKA

ÚČASTNÍCI:

Workshop je určený ALM/Treasury profesionálom, produktovým a projektovým manažérom pre oblasť ALM/Treasury, risk manažérom, ako aj bankovým odborníkom a expertom z iných súvisiacich útvarov (audit, risk management, back-office, compliance atď.).

CIEĽ:

Riadenie úrokového rizika je dôležitou súčasťou riadenia aktív a pasív (ALM - Assets and Liabilities Management). ALM musí zabezpečiť správne mapovanie všetkých bilančných položiek, vrátane administrovaných produktov bez splatnosti. ALM tiež pripravuje úrokové gapy a priradenie správnej vnútornej ceny (FTP). Modelovanie administrovaných produktov má svoje špecifiká, a zároveň je potrebné dodržiavať pritom aj príslušnú reguláciu (IRRBB).

OBSAH SEMINÁRA:

- Úvod do ALM – úlohy ALM v banke, vzťahy s Treasury, riadením rizík a kontrolíngom
- Identifikácia úrokového rizika s využitím FTP(IR), počítanie profitability z úrokových rozdielov
- Riadenie úrokového rizika banky
 - Metódy mapovania bilančných položiek banky pre účely riadenia úrokového rizika - replikačné portfóliá pre administrované produkty a položky bez definovanej splatnosti
 - Úrokové gapy a meranie úrokového rizika
 - Výnos zo štruktúry bilancie, preceňovanie, dynamické riadenie a súvisiace riziká
 - Regulácia úrokového rizika - IRRBB (Interest Rate Risk of the Banking Book)
- Riadenie úrokového rizika s využitím produktov finančného trhu: peňažný trh (FRA, MM Future, OIS), trh fixných dlhodobých sadziieb (interest rate swaps, bond futures)
- Príklady a prípadové štúdie z praxe, výpočty a vysvetlenia v exceli, Bearing ALM model (IR časť) na replikačné portfóliá

LEKTOR: **Martin Macko**, partner Bearing, s.r.o.

lektor s dlhoročnými skúsenosťami v oblasti riadenia banky a riadenia aktív a pasív, treasury a finančných trhov, riadenia trhových rizík, bankovej regulácie

ORGANIZAČNÉ POKYNY

TERMÍN KONANIA:

3. december 2020

GARANT PODUJATIA:

Ing. Mario Goliaš

☎ +421 905 436 719

e-mail: mario.golias@nbs.sk

TECHNICKÁ REALIZÁCIA:

Seminár bude prebiehať on-line cez platformy Microsoft Teams, Zoom alebo Skype, ktoré umožňujú vzdialenú komunikáciu a zdieľanie vysielajúcej obrazovky. Ak účastníci nemajú na PC nainštalovaný MS Teams, Zoom alebo Skype, je možné použiť pripojenie cez web.

Na pripojenie on-line postačuje štandardný web prehliadač a notebook, tablet alebo PC s reproduktormi/slúchadlami a mikrofónom.

Podrobnejšie informácie ohľadom pripojenia a priebehu školenia poskytneme prihláseným účastníkom pred konaním kurzu.

ČASOVÝ HARMONOGRAM:

vyučovanie:

9.00 h – 16.00 h

ÚČASTNÍCKY POPLATOK:

na 1 účastníka bez DPH

262,00 EUR

na 1 účastníka vrátane 20 % DPH

314,40 EUR

BANKOVÉ SPOJENIE:

IBAN:

SK08 0720 0000 0000 0007 4069

SWIFT:

NBSB SK BX

Variabilný symbol: 2099

Konštantný symbol: 0308

KONTAKTNÉ ÚDAJE:

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.

Drieňová 1081/31

821 01 Bratislava - Ružinov

IČO: 42166373

DIČ: 2022730369

IČ DPH: SK2022730369

Vysielajúce organizácie uhradia účastnícky poplatok do termínu uzávierky, t.j. 26. novembra 2020, a priloženú IDENTIFIKÁCIU PLATBY (s názvom podujatia) zašlú ihneď po jeho úhrade na adresu IBV NBS, n. o. Pri prezentácii sa účastníci preukážu kópiou výpisu z účtu. Účastnícky poplatok nie je možné uhrádzať poštovým peňažným poukazom.

PODMIENKY ZRUŠENIA ÚČASTI:

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.

Dovoľujeme si Vás upozorniť, že v prípade **nestornovanej záväznej prihlášky si IBV NBS, n.o. vyhradzuje právo vyfakturovať účastnícky v plnej výške.**

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

**Vyplnené a potvrdené záväzné prihlášky zasielajte na e-mailovú adresu:
mario.golias@nbs.sk najneskôr do 26. novembra 2020.**

Prihlásenie je možné aj prostredníctvom online formulára na stránke www.ibv-nbs.sk.

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.

Ing. Tomáš Sokol, PhD.
riaditeľ

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n. o.