



INŠTITÚT BANKOVÉHO  
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

**Pozvánka na workshop**

# **ALM**

# **RIADENIE LIKVIDITY BANKY**

**Bratislava**  
**15. október 2020**

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



# ***ALM - RIADENIE LIKVIDITY BANKY***

## **ÚČASTNÍCI:**

Zamestnanci bánk z oblasti ALM/Treasury, projektoví a produktoví manažéri pre oblasť ALM/Treasury, bankoví odborníci a experti z iných súvisiacich oddelení (audit, risk manažment, back-office, compliance ....). Workshop je vhodný pre zamestnancov bánk, ktorí majú záujem porozumieť problematike riadenia likvidity na praktických príkladoch a simuláciách.

## **CIEĽ:**

Riadenie likvidity je dôležitou súčasťou riadenia aktív a pasív (ALM) a celkového riadenia banky. Cieľom workshopu je oboznámiť účastníkov so spôsobmi mapovania bilančných položiek banky pre účely likvidity, vysvetliť modelovanie administrovaných produktov (bez definovanej splatnosti), a správne identifikovať jednotlivé riziká pri riadení likvidity. Súčasťou workshopu sú prípadové štúdie a praktické simulácie v Exceli.

## **OBSAH SEMINÁRA:**

- Úlohy riadenia aktív a pasív (ALM) v banke, vzťahy s Treasury, riadením rizík a kontroľom
- Vnútročné ceny FTP (Funds Transfer Price) pre riadenie likvidity, nastavenie a pravidlá používania v banke, kontingenčné prirážky FTP, ďalšie FTP prispôbenia
- Identifikácia likviditného rizika s využitím FTP(LQ), počítanie profitability z likviditných rozdielov, likviditná rezerva
- Riadenie likvidity banky
- Metódy mapovania bilančných položiek banky pre účely riadenia likvidity - replikačné portfóliá pre administrované produkty a položky bez definovanej splatnosti
- Likviditné gapy a meranie rizika likvidity, stanovenie minimálnej likvidity
- Likviditná krivka a likviditné náklady/prémie
- Stresové scenáre pre riadenie likvidity
- Ukazovatele likvidity (LCR/NSFR)
- Proces ILAAP (Internal liquidity adequacy assessment process)
- Produkty finančných trhov na riadenie likvidity: Peňažný trh (Depo, CD, CP, T-bills, Repo), kapitálový trh (dlhopisy) - produkty (rôzne druhy dlhopisov, rôzne druhy swapov, futures)
- Prípadové štúdie z praxe a simulácie na modeloch v Exceli

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

- lektor má dlhoročné skúsenosti v oblasti riadenia banky a riadenia aktív a pasív, treasury a finančných trhov, riadenia trhových rizík, bankovej regulácie

## **ORGANIZAČNÉ POKYNY**

**TERMÍN KONANIA:** **15. október 2020**

**MIESTO KONANIA:** Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.  
Drieňová 31 (budova Doprastavu)  
Bratislava - Ružinov

**GARANT PODUJATIA:** Ing. Mario Goliaš  
☎ +421 905 436 719  
e-mail: [mario.golias@nbs.sk](mailto:mario.golias@nbs.sk)

### **ČASOVÝ HARMONOGRAM:**

prezentácia: **8.45 h – 9.00 h**  
vyučovanie: **9.00 h – 17.00 h**

### **ÚČASTNÍCKY POPLATOK:**

na 1 účastníka bez DPH **262,00 EUR**  
na 1 účastníka vrátane 20 % DPH **314,40 EUR**

**V účastníckom poplatku je zahrnuté občerstvenie.**

**BANKOVÉ SPOJENIE:** **IBAN:** **SK08 0720 0000 0000 0007 4069**  
**SWIFT:** **NBSB SK BX**  
**Variabilný symbol:** **2097**  
**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. 9. októbra 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 poplatok v plnej výške.**

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

### **DOPRAVA NA MIESTO KONANIA SEMINÁRA:**



Mestskou hromadnou dopravou:

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

bližšie informácie o MHD: <http://www.imhd.sk/ba>

Autom: parkovanie v okolí

*Dovoľujeme si Vás upozorniť, že účastníci sú povinní preukázať sa pri vstupe do budovy platným občianskym preukazom.*

**Vyplnené a potvrdené záväzné prihlášky zasielajte na e-mailovú adresu:  
[mario.golias@nbs.sk](mailto:mario.golias@nbs.sk) najneskôr do 9. októbra 2020.**

**Prihlásenie je možné aj prostredníctvom online formulára na stránke [www.ibv-nbs.sk](http://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.