



INŠTITÚT BANKOVÉHO
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

Pozvánka na online seminár

REFORMA ÚROKOVÝCH BENCHMARKOV

**Bratislava
28. september 2021**

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



REFORMA ÚROKOVÝCH BENCHMARKOV

ÚČASTNÍCI:

Workshop je určený ALM/treasury profesionálom, produktovým a projektovým manažérom pre oblasť ALM/treasury, risk manažérom, bankovým odborníkom a expertom z iných súvisiacich útvarov (audit, back office, compliance, účtovníctvo atď.), ako aj všetkým zamestnancom so záujmom porozumieť uvedenej problematike.

CIEĽ:

Cieľom seminára je poskytnúť informácie o nových bezrizikových úrokových sadzbách RFR, ktoré nahrádzajú pôvodné medzibankové úrokové sadzby xIBOR a zároveň získať informácie o tom, aký dopad má používanie nových RFR na investorov, banky a na klientov bánk, a zároveň spoznať právne, technické a matematické aspekty pri prechode na nové úrokové benchmarky.

OBSAH SEMINÁRA:

- Nové úrokové benchmarky - bezrizikové sadzby (risk-free rates - RFR): regulačné štandardy, rozdiely, referenčné sadzby hlavných mien (ESTER, SOFR, SARON, SONIA, TONA), konvencie pre výpočty dní
- Porovnanie s pôvodnými referenčnými sadzbami EURIBOR, EONIA, LIBOR, inými xIBOR, a ich konvencie
- Odporúčané štandardy centrálnych bánk (pracovná skupina ECB pre RFR, pracovná skupina BoE SONIA, FED ARRC) a asociácie (LMA, ISDA)
- Prechod z xIBOR na nový RFR, multiple-rate prístup alebo použitie existujúcej O/N úrokovej sadzby
- Výpočtové alternatívy a ako aplikovať O/N RFR fixácie na dlhšie splatnosti:
 - backward-looking (in-arrears): priemerovanie a zlučovanie, s posunom pozorovania alebo bez neho
 - forward-looking
- Použitie nových RFR:
 - použitie s rôznymi triedami aktív: štandardné bankové produkty (rôzne druhy úverov, úvery zabezpečené swapom), dlhopisy s pohyblivou úrokovou sadzbou, deriváty (swapy, futures, opcie)
 - Modely FTP s novými referenčnými hodnotami
- Basis swap in-arrears

- Právne problémy s novými referenčnými úrokovými sadzbami, záložný protokol ISDA (fallback)
 - prípadové štúdie a príklady výpočtov
 - in-arrears swap vs. štandardný swap
 - úver & Swap hedging
 - komplexné ALM riešenie a optimalizácia súvahy banky (MORS software prípadová štúdia)

LEKTOR:

Ing. Martin Macko, zakladajúci partner a výkonný riaditeľ spoločnosti Bearning s.r.o. s dlhoročnými skúsenosťami v oblasti riadenia banky, treasury a finančných trhov, riadenia aktív a pasív, bankovej regulácie, privátneho bankovníctva, Corporate Sales. Má dlhoročné skúsenosti ako lektor, poradca a manažér vzdelávacích projektov v uvedených oblastiach. Pôsobil ako riaditeľ divízie Treasury vo viacerých bankách, v súčasnosti pôsobí ako lektor na Univerzite Komenského v Bratislave, predmet „Strategické riadenie finančných inštitúcií“. Podieľal sa na projektoch v oblasti finančných trhov a ALM (vnútorné ceny FTP pre úrokové riziko, likviditu a kreditné spready, Basel 2/3, MIFID II).

ORGANIZAČNÉ POKYNY

TERMÍN KONANIA:

28. september 2021

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

268,00 EUR

na 1 účastníka vrátane 20 % DPH

321,60 EUR

BANKOVÉ SPOJENIE:

IBAN: SK08 0720 0000 0000 0007 4069
SWIFT: NBSB SK BX
Variabilný symbol: 2228
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. 21. septembra 2021, 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:

Záväznú 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 21. septembra 2021.**

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.