



INŠTITÚT BANKOVÉHO
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

Pozvánka na online workshop

ÚROKOVÉ RIZIKO A REGULÁCIA IRRBB

**Bratislava
9. november 2022**

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



ÚROKOVÉ RIZIKO A REGULÁCIA IRRBB

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 atď.), ako aj všetkým zamestnancom so záujmom porozumieť uvedenej problematike.

CIEĽ:

Cieľom workshopu je poskytnúť informácie o implementácii poslednej regulácie o úrokovom riziku v bankovej knihe – IRRBB, ktorá sa stala pre mnohé banky výzvou. Súlad s IRRBB vyžaduje dôsledne merať úrokové riziko a jeho podtypy (riziko výšky úrokovej sadzby, riziko tvaru výnosovej krivky, bázičné riziko, opcionalitu a riziko kreditného spreadu).

OBSAH WORKSHOPU:

Mapovanie a meranie IRR

- Úspešné meranie IRR: FTP systém, nové referenčné ceny po zrušení xIBOR benchmarkov
- Zásady mapovania IRR: štandardné bankové produkty, vklady/aktíva bez definovanej splatnosti (NMD/NMA), rozklad skrytej opcionality (floorlets/caplets), produkty s pevným výnosom (dlhopisy, swapy, ...), ostatné deriváty
- Na oživenie: durácia, konvexita, zero krivka, PV01, analýza scenárov, VaR, Expected shortfall – klady a zápory
- Porozumenie rôznych zložiek úrokového rizika; meranie podtypov rizika IRRBB: IR gapy a riziko úrovne úrokovej sadzby (level risk), výnosová krivka, bázičné riziko, opcionalita, CSRBB

Regulačné požiadavky a osvedčené postupy

- Prehľad regulačných požiadaviek na riadenie rizika likvidity a úrokových sadzieb od reforiem Basel I po Basel III
- Normy BCBS IRRBB a revidované normy EÚ (EBA GL 2018/02)
- Minimálne štandardy pre vyhovujúcu banku
- Dostupné regulačné metriky: EaR, EV, EVE, VaR
- Efektívny rámec riadenia úrokových rizík a riešenia výziev vyplývajúcich z regulácie

Riadenie súvahy a hedging IRR

- Riadenie súvahy – návrh a implementácia hedgingových stratégií
- Nástroje finančného trhu na zabezpečenie úrokových rizík: swapy, dlhopisy, futures, opcie (cap, floor, swaption)

LEKTOR:

Ing. Martin Macko, zakladajúci partner a výkonný riaditeľ spoločnosti Bearing 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:

9. november 2022

GARANT PODUJATIA:

Ing. Mario Goliaš

☎ +421 905 436 719

e-mail: mario.golias@ibv-nbs.sk

TECHNICKÁ REALIZÁCIA:

Workshop 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 workshopu.

ČASOVÝ HARMONOGRAM:

vyučovanie:

9:00 h – 16:00 h

ÚČASTNÍCKY POPLATOK:

na 1 účastníka bez DPH

280,00 EUR

na 1 účastníka vrátane 20 % DPH

336,00 EUR

BANKOVÉ SPOJENIE:**IBAN: SK08 0720 0000 0000 0007 4069****SWIFT: NBSB SK BX****Variabilný symbol: 2438****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. 3. novembra 2022. 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>.

Vyplnené a potvrdené záväzné prihlášky zasielajte na e-mailovú adresu:

mario.golias@ibv-nbs.sk najneskôr do 3. novembra 2022.

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.