



INŠTITÚT BANKOVÉHO  
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

**Pozvánka na online workshop**

# **ALM - RIADENIE LIKVIDITY**

**14. december 2022**

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



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

### **ÚČASTNÍCI:**

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

### **CIEĽ:**

Riadenie likviditného 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, pripraviť relevantný výstup (likviditný gap). Dôležité je správne priradovanie likviditnej prémie (FTP-LQ). Modelovanie administrovaných produktov má svoje špecifiká, a zároveň je potrebné dodržiavať reguláciu.

### **OBSAH WORKSHOPU:**

- Úlohy riadenia aktív a pasív (ALM) v banke, vzťahy s Treasury, riadením rizík a kontrolingom
- Vnútorne ceny FTP (Funds Transfer Price) pre riadenie likvidity (LQ), nastavenie a pravidlá používania v banke, kontingenčné prirážky FTP(LQ), ďalšie FTP(LQ) 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 a NSFR)
- Proces ILAAP (Internal Liquidity Adequacy Assessment Process)
- Produkty finančných trhov na riadenie likvidity: peňažný trh (Depo, CD, CP, T-bills, Repo, FX swap), trh fixných dlhodobých sadzieb (dlhopisy)
- Príklady a prípadové štúdie z praxe, simulácie a výpočty na modeloch v Exceli, Bearing ALM model (LQ časť) na replikačné portfólio

**LEKTOR:** Ing. Martin Macko, partner Bearning, 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**

**ERMÍN KONANIA:**

**14. december 2022**

**GARANT PODUJATIA:**

Ing. Mario Goliaš

☎ +421 905 436 719

e-mail: [mario.golias@ibv-nbs.sk](mailto: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 kurzu.

**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: 2437**

**Konštantný symbol: 0308**

**KONTAKTNÉ ÚDAJE:**

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.

Ulica Imricha Karvaša 6851/1

811 07 Bratislava – Staré Mesto

IČO: 42166373

DIČ: 2022730369

IČ DPH: SK2022730369

**Vysielajúce organizácie uhradia účastnícky poplatok do termínu uzávierky, t.j. 8. decembra 2022,** 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 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 8. decembra 2022.**

**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.