

Про Конференцію

VIII Щорічна Конференція «Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності Market|Risk|2019» відбудеться 9 жовтня 2019 року у Києві, Україна.

Метою Конференції є огляд макроекономічних перспектив та Монетарної Політики НБУ, а також обмін досвідом щодо кращої практики в управлінні ризиками ліквідності, процентного ризику та ринкових ризиків в рамках завдань, що стоять перед банками у Постанові НБУ №64, та у рамках перспективного регулювання.

- Доповідь НБУ щодо макроекономічних перспектив та Монетарної Політики
- Унікальні Панельні дискусії щодо макроекономічних шоків, впровадження показника NSFR та капіталу під ринкові ризики
- Презентації провідних експертів по практиці управління ризиком ліквідності та ринковими ризиками

Спікери Конференції



Дмитро
Солугуб
Заступник
Голови
НБУ



Юрій Блашук
Незалежний
член
Наглядової
Ради
Укргазбанк



Тарас Проць
Член Правління,
Головний Ризик
Менеджер
ОТП Банк



Тетяна
Сотникова
Член
Правління,
Головний
Ризик
Менеджер
Піреус Банк
МКБ



Сергій
Ніколайчук
Директор
Департа-
менту
монетарної
політики та
економіч-
ного
аналізу
НБУ



Віталій
Вавришчук
Директор
департаменту
фінансової
стабільності
НБУ



Ганна
Самаріна
Заступник
Голови
Правління (з
питань
фінансів)
ПриватБанк



Олексій
Шклярчук
Член Правління,
Головний Ризик
Менеджер
Агропротсперіс
Банк



Олена
Коробкова
Виконавчий
директор
НАБУ



Ігор
Будник
екс-
Директор
Департа-
менту
управління
ризиками
НБУ



Ганна
Рубльова
Начальник
Управління
активами та
пасивами та
контролінгу
Казначейства
ОТП Банк



Олексій
Назаров
Начальник
Управління
ринкових
ризиків та
ризиків
фінансових
інститутів
Райффайзен
Банк Аваль



Марина
Семенець
Керівник
управління
ринковими
ризиками
ПриватБанк



Ярослав
Невмержицький
FRM ERP
CFA
Заступник
Головного
Ризик
менеджера
Нафтогаз
України



Юлія
Шевчук
FRM
Консуль-
тант з
управління
ризиками
Finastra

Ексклюзивний Партнер з Ризик Менеджменту



Партнери



НАДІЙНИЙ З 1916 РОКУ



Інформаційні партнери



Кому рекомендовано

У Вашому банку, фінансовій чи інвестиційній компанії:

- Голові та членам Наглядової ради та Правління
- Керівництву підрозділів:
 - Ризик менеджменту,
 - Управління ринкових ризиків та ризику ліквідності,
 - Управління активами та зобов'язаннями,
 - Фінансового планування та бюджетування,
 - Казначейства та ділінгу,
 - Цінних паперів,
 - Корпоративного та роздрібного бізнесу,
 - Інвестиційного бізнесу,
 - Кореспондентських відносин,
 - Оцінки банків-контрагентів,
 - Розробки та впровадження аналітичних систем та інформаційних технологій

Відгуки про минулі Конференції

- «Можливість почути поточні тенденції, напрями розвитку в сфері банківського сектора, проблеми, виклики, можливі рішення», — **Михайло Відякин**, Заступник Директора департаменту стратегії та реформування, **НБУ**
- «Відмінний підбір спікерів та тем для обговорення», - — **Тетяна Сотникова**, Член Правління, Головний ризик менеджер, **Піреус Банк**
- «Можливість обговорити відкриті питання з колегами під час перерв, відмінна загальна організація та тематика доповідей», — **Надія Мещенко**, Начальник управління ринкових ризиків, **Укрсоцбанк**
- «Дякую за можливість обговорити з колегами з інших банків актуальні проблеми та методи їх вирішення», - **Ярослав Стецик**, Начальник відділу інтегрованих та ринкових ризиків, **Сбербанк Росії**



Спікери Конференції (підтверджені)

- **Дмитро Сологуб**, Заступник Голови, **НБУ**
- **Юрій Блащук**, Незалежний член Наглядової Ради, **Укргазбанк**
- **Тарас Проць**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, **ОТП Банк**
- **Ганна Самаріна**, Заступник Голови Правління (з питань фінансів), **ПриватБанк**
- **Тетяна Сотникова**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, **Піреус Банк МКБ**
- **Сергій Ніколайчук**, Директор Департаменту монетарної політики та економічного аналізу, **НБУ**
- **Олексій Шклярчук**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, **Агропросперіс Банк**
- **Віталій Ваврищук**, Директор Департаменту фінансової стабільності, **НБУ**
- **Олена Коробкова**, Виконавчий директор, **НАБУ**
- **Назар Одинаєв**, Директор Департаменту фінансових ризиків, **Банк Креді Агриколь**
- **Марина Семенець**, Керівник управління ринковими ризиками, **ПриватБанк**
- **Ігор Будник**, экс-Директор Департаменту управління ризиками, **НБУ**, Член Управляючого Комітету, **GARP Ukraine**
- **Ганна Рубльова**, Начальник Управління активами і пасивами та контролінгу Казначейства, **ОТП Банк**
- **Олексій Назаров**, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Ярослав Невмержицький**, FRM, ERP, CFA, Заступник Головного Ризик Менеджера, **Нафтогаз України**
- **Юрій Табін**, Заступник Директора Департаменту ринкового ризику та ризику ліквідності, **Кредобанк**
- **Юлія Шевчук**, FRM, Міжнародний консультант з управління ризиками, **Finastra**

Сесія: Макроекономіка та банківський та фінансовий сектор України

Презентація. Перспективи макроекономічного розвитку України та Монетарна політика НБУ

- **Дмитро Сологуб**, Заступник Голови, **НБУ**
- Перспективи макроекономічного розвитку України
- Огляд викликів і ризиків для країни, можливих зовнішніх і внутрішніх шоків, їх вплив на банківський і фінансовий сектор України
- Превентивні дії НБУ по цим ризикам, що включає його Монетарну політику і поточне та перспективне регулювання.

Панельна дискусія. Макроекономічні ризики та їх вплив на банківську систему України. Як до цього готувати Ваш банк вже зараз?

- Які є макроекономічні ризики внутрішнього і зовнішнього характеру? Рецесія світової економіки? Відплив капіталу з України? Поведінка нерезидентів на ринку ОВДП? Інтенсивна трудова міграція з України? Інші?
- Як вони можуть вплинути на ризики банківського та фінансового сектору?
- Як Наглядова Рада та Правління банку мають вже зараз підготувати свій банк до цього?

Учасники Панельної дискусії:

- **Сергій Ніколайчук**, Директор Департаменту монетарної політики та економічного аналізу, **НБУ**
- **Юрій Блащук**, Незалежний член Наглядової Ради, **Укргазбанк**
- **Ганна Самаріна**, Заступник Голови Правління (з питань фінансів), **ПриватБанк**
- **Тарас Проць**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, **ОТП Банк**
- **Олена Коробкова**, Виконавчий директор, **НАБУ**

Сесія: Реалізація Постанови НБУ №64 щодо ризику ліквідності та ринкових ризиків

Презентація. Впровадження Плану фінансування в кризових ситуаціях. Досвід ПриватБанку.

- **Марина Семенець**, Керівник управління ринковими ризиками, **ПриватБанк**
- Визначення кількісних та якісних індикаторів кризи ліквідності із застосуванням підходу світлофора.
- Побудова процесу моніторингу індикаторів кризи ліквідності та налаштування ескалації порушень показників.
- Управління ліквідністю в період кризи. Визначення переліку заходів по відновленню ліквідності в період кризи.

Презентація. Коефіцієнт стабільного фінансування NSFR. Досвід впровадження OTP банку.

- **Ганна Рубльова**, Начальник Управління активами і пасивами та контролінгу Казначейства, **ОТП Банк**
- Вступ: виважена структура пасивів банків як запорука стійкості системи – основний мотив запровадження NSFR Базельским комітетом з питань банківського нагляду
- Структура активів – визначальний чинник потреб у стабільному фінансуванні; порівняння підходів Базелю та пропозицій НБУ;
- Порівняння підходів Базелю та пропозицій НБУ щодо визначення наявного стабільного фінансування. Досвід OTP Банку щодо визначення стабільності клієнтських залишків.

Панельна дискусія. Коефіцієнт стабільного фінансування NSFR для банків України: Відкриті питання щодо проекту НБУ методики розрахунку NSFR від 12.03.2019:

- Загальні питання. З якою частотою буде здійснюватися моніторинг дотримання NSFR? Європейська практика – щоквартально. Чи передбачаються підвищені вимоги по NSFR для системно важливих банків?
- Розрахунок NSFR буде здійснюватися в розрізі окремих валют, а ліміт стосуватися для стабільного фінансування в цілому? Як визначити валюту стабільного фінансування для валютних ОВДП, які беруть участь у розрахунку LCR у гривні?
- Чому депозитні сертифікати НБУ отримують вищі RSF у порівнянні з ОВДП, якщо вони теж HQLA?
- Операції зворотного репо з НБУ отримали 10-15% RSF в порівнянні з підходом Базеля, що передбачає RSF?
- Як визначити RSF для овердрафтів та для інших продуктів з достроковим погашенням?

- Строки погашення активів визначаються на основі контрактних грошових потоків з урахуванням опціональності?
- Пропозиції щодо врахування деривативів до розрахунку NSFR за справедливою вартістю з можливістю зарахування зустрічних вимог з одним контрагентом
- Позабалансову заставу, що є HQLA та отримана за операціями репо з переходом права власності, враховуємо як обтяжений актив?

Учасники Панельної дискусії:

- **Віталій Ваврищук**, Директор Департаменту фінансової стабільності, **НБУ**
- **Тетяна Сотникова**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, **Піреус Банк МКБ**
- **Олексій Шклярчук**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, **Агропросперіс Банк**
- **Ганна Рубльова**, Начальник Управління активами і пасивами та контролінгу Казначейства, **ОТП Банк**
- **Олексій Назаров**, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів, **Райффайзен Банк Аваль**

Презентація. Використання моделі GARCH для оцінки ринкових ризиків.

- **Ярослав Невмержицький**, FRM, ERP, CFA, Заступник Головного Ризик Менеджера, **Нафтогаз України**
- Вибір методу визначення ціни ринкового ризику. Огляд методів моделювання. На скільки вони адекватно оцінюють ціну ризику (демонстрація результатів оцінки ліміту різними методами, зокрема, і передбаченими у Постанові НБУ №64 (історичний, параметричний, сценарний по Монте Карло, (G)ARCH))?
- GARCH як оптимальний компроміс між складністю, інформаційними потребами, interpretability та точністю. А як щодо прогнозування на основі GARCH?
- Як інтерпретувати параметри базової (vanila) GARCH моделі. GARCH vs EWMA: подібності і відмінності.
- Оцінки ефективності (валідація) GARCH моделі - пробої, переоцінка/недооцінка ринкового ризику.
- Виявлення слабких місць vanila GARCH та способи її усунення.

Сесія: Перспективне регулювання НБУ: Розподіл капіталу під ринкові ризики

НБУ планує впровадити регуляторні вимоги щодо алокації капіталу під ринкові ризики. Тому для НБУ та банків важливо вже зараз вивчити досвід того, як відбувається розрахунок та алокація капіталу під ринкові ризики згідно вимог ЄС.

Презентація. Розрахунок та алокація капіталу під ринкові ризики. Досвід Райффайзен банку Аваль.

- **Олексій Назаров**, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів, **Райффайзен Банк Аваль**
- Система розрахунку капіталу під ринкові ризики: Як ми розраховуємо суму капіталу під ринкові ризики? Як інструменти та моделі використовуються для цього?
- Як зробити цю систему практичною у процесі прийняття рішень в банку?
- Бюджетування капіталу: Як потрібно впроваджувати алокацію капіталу під ринкові ризики в бюджетний процес банку?
- Як мотивувати бізнес до управління ринковими ризиками? Організаційні питання управління ринковими ризиками: визначення бізнес-власника ризику, настройка мотивації до управління ринковими ризиками, дотримання бюджетних показників, розумне реагування на відхилення від норми, культура і ставлення ризик-менеджера.

Панельна дискусія: Впровадження моделі розрахунку та алокації капіталу під ринкові ризики.

Учасники Панельної дискусії:

- **Ігор Будник**, екс-Директор Департаменту управління ризиками, **НБУ**, Член Управляючого Комітету, **GARP Ukraine**
- **Олексій Назаров**, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Назар Одинаєв**, Директор Департаменту фінансових ризиків, **Банк Креді Агриколь**
- **Юрій Табін**, Заступник Директора Департаменту ринкового ризику та ризику ліквідності, **Кредобанк**

Фуршет

До програми Конференції можуть бути внесені зміни

Інформація для учасників

Місце проведення Конференції Конференц-Хол ДЕПО
(Київ, вул. Антоновича, 50)

Робоча мова Конференції – українська та російська. Для англomовних доповідей буде наданий перекладач.

Вартість участі одного представника у роботі Конференції:

	Конференція (9 жовтня 2019)
для представників організацій-резидентів України (грн)*	8950
для представників організацій-нерезидентів України (EUR)	300

*без ПДВ, єдиний податок

У вартість входять матеріали, обіди та кава брейки.

Знижки на участь у Конференції:

Для представників організацій, від яких є спікери на цій конференції	50%
Для членів GARP та UUPN	5%
Для постійних клієнтів	5%

Знижки додаються.

УВАГА! АКЦІЯ «1+1»:

- Для банків та фінансових організацій: При оплаті за одного представника другий представник цієї організації бере участь у Конференції **БЕЗКОШТОВНО**.
- Для інших організацій: При оплаті за одного представника другий представник цієї організації бере участь у Конференції **ЗІ ЗНИЖКОЮ 60%**.

Умови цієї Акції:

- 1) Акція діє **до 16 вересня 2019** включно.
- 2) Акція не діє з іншими знижками.
- 3) Оплата за участь має відбутися до кінцевої дати дії цієї акції.

Для участі у роботі Конференції, будь ласка, заповніть заявку і надішліть її на e-mail: office@extra-consulting.net. При отриманні Вашої заявки ми надішлемо Вам рахунок на оплату.

З питань маркетингових можливостей та спонсорства, будь ласка, звертайтеся за e-mail: marketing@extra-consulting.net.

Оргкомітет Конференції:

компанія «Екстра Консалтинг»
тел.: +38 (044) 227 81 73
e-mail: office@extra-consulting.net
сайт: www.extra-consulting.net

Про організатора

EXTRA
consulting

Екстра Консалтинг (www.extra-consulting.net) – провідний провайдер в Україні банківських семінарів, конференцій та консалтингу, яка вже 18 років реалізує свою місію в поширенні серед банків та фінансових компаній України та СНД найкращої світової практики менеджменту та сучасних інформаційних технологій для покращення ефективності їх роботи. Компанія реалізує цю місію завдяки комбінації досвіду українських та міжнародних консультантів, провівши вже близько 500 семінарів, в яких взяло участь понад 6000 слухачів, основна частина яких - представники вищого та середнього менеджменту. Компанія проводить чотири конференції на рік - з управління операційними ризиками (березень), кредитними ризиками (червень), ринковими ризиками та ризиком ліквідності (жовтень) та управлінню доходністю та ризиками (грудень). Консультанти компанії з успіхом виконали ряд консалтингових проектів для банків України, Республіки Білорусь, Росії, Киргизстану, Таджикистану, країн Західних Балкан та Східного Партнерства.

Про Finastra

FINASTRA

Пропонуючи відкриті інноваційні IT-платформи, Finastra допомагає максимально розкривати потенціал в сфері фінансів. Заснована у 2017 році злиттям компаній Misys і D + N, компанія Finastra пропонує найширший спектр фінансових програмних рішень в світі на сьогоднішній день - в тому числі системи для підтримки роздрібного банкінгу, транзакційного банкінгу, кредитування, а також казначейства і ринків капіталу. Рішення Finastra дозволяють клієнтам впроваджувати і використовувати критично важливі технології як на своїх майданчиках, так і в хмарних технологіях. Масштаб і географічний діапазон діяльності компанії підтверджують здатність Finastra здійснювати ефективне обслуговування клієнтів незалежно від їх розміру та місцезнаходження - будь то глобальні фінансові інститути або регіональні банки та кредитні спілки. Завдяки відкритим, безпечним і надійним рішенням клієнти Finastra знаходять можливість прискорити темпи зростання бізнесу, оптимізувати витрати, знизити ризики і постійно вдосконалювати свій продуктовий портфель відповідно до динамічно змінюваними потребами клієнтів. Технологіями Finastra користуються 48 з 50 найбільших банків світу. Відвідайте сайт: finastra.com.

Детальна інформація на сайті www.extra-consulting.net або за тел. +380 44 227 81 73

ЗАЯВКА
НА УЧАСТЬ

VIII Щорічна Конференція
Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності

market|risk|2019

9 жовтня 2019 | Київ, Україна

Просимо зареєструвати представників нашої організації
(будь ласка, позначте свій вибір у за допомогою V або X):

ПІБ Посада e-mail Член UUPN Член GARP	<input type="checkbox"/> так <input type="checkbox"/> так Якщо «так», вкажіть GARP ID _____
ПІБ Посада e-mail Член UUPN Член GARP	<input type="checkbox"/> так <input type="checkbox"/> так Якщо «так», вкажіть GARP ID _____

Усього вартість _____

Назва організації: _____

Адреса: _____

Контактна особа: _____

Контактний телефон: (____) _____

На який E-mail відправити рахунок: _____

Оплату до початку конференції гарантуємо.

Керівник _____

Заявку, будь ласка, надішліть на e-mail office@extra-consulting.net