

О Конференции

IX Ежегодная Конференция «Управление рыночными рисками и риском ликвидности Market|Risk|2020» состоится 9 октября 2020 в Киеве, Украина.

Целью Конференции является обзор макроэкономических перспектив и рисков для финансового сектора в условиях COVID-19, обсуждение регуляторных требований к капиталу под рыночные риски, а также обмен опытом по лучшей практики в оценке деривативов и их использовании для хеджирования рыночных рисков банками и их клиентами

- COVID-19 и финансовый сектор: какие результаты и перспективы?
- Какие будут требования НБУ к капиталу под рыночные риски?
- Деривативы: как оценивать и хеджировать риски?
- Как запустить валютные фьючерсы?

Спикеры Конференции



Виталий Ваврицук
Директор
департамента
финансовой
стабильности
НБУ



Руслан Спивак
Директор
Корпоративно
го бизнеса
**Райффайзен
Банк Аваль**



Надежда Мешенко
FRM
Начальник
управления
финансовых и
операционных
рисков
НБУ



Николай Селехман
FRM, CFA
Заместитель
Директора
Департамента
открытых
рынков
НБУ



Дмитрий Колечко
Член
Правления,
Главный Ри
Менеджер
VP Bank
(Вьетнам)



Александр Дуда
Начальник
Центра
рынков
капитала
УкрСиббанк



Первин Дадашова
FRM
Начальник
управления
макропруден
циальной
политики и
исследований
НБУ



Олег Ткаченко
Председатель
Правления
Банк
Расчетный
Центр



Назар Одинаев
Директор
Департамента
финансовых
рисков,
Банк Креди
Агриколь



Алексей Сухоруков
Директор
по
развитию
бизнеса
Украинская
биржа



Алексей Назаров
Начальник
Управления
рыночных
рисков и
рисков
финансовых
институтов
**Райффайзен
Банк Аваль**



Юрий Табин
Заместитель
Директора
Департамента
рыночного
риска и риска
ликвидности
Кредобанк



Анна Рублева
Директор
Департамента
управления
финансовыми
рисками
ОТП Банк



Вячеслав Озеров
Директор
Департа
мента
Казначейства
Банк Креди
Агриколь



Ярослав Невмержийкий
FRM, ERP, C
Главный Ри
Менеджер
U.Commodi
s

Партнеры



НАДЕЖНЫЙ С 1916 ГОДА



Информационные партнеры

Кому рекомендуется

В Вашем банке, финансовой или инвесткомпании:

- Председателю и членам Правления и Наблюдательного Совета
- Руководству подразделений:
 - Риск менеджмента,
 - Управления рыночных рисков и риска ликвидности,
 - Управлению активами и обязательствами,
 - Финансового планирования и бюджетирования,
 - Казначейства и дилинга,
 - Ценных бумаг,
 - Корпоративного и розничного бизнесов,
 - Инвестиционного бизнеса,
 - Корреспондентских отношений,
 - Оценки банков-контрагентов,
 - Разработки и внедрения аналитических систем и информационных технологий

Отзывы о прошедших конференциях

- «Возможность услышать текущие тенденции, направления развития в сфере банковского сектора, проблемы, вызовы, возможные решения», — **Михаил Видякин**, Заместитель Директора департамента стратегии и реформирования, **НБУ**
- «Понравилась подготовка и проведение самой конференции» - **Валентина Никитенко**, Независимый член Наблюдательного совета, **ТАСкомбанк**
- «Отличный подбор спикеров и тем для обсуждения», — **Татьяна Сотникова**, Член Правления, Главный риск менеджер, **Пиреус Банк**
- «Интересная, очень актуальная тема, формат, спикеры» - **Назар Одинаев**, Директор Департамента финансовых рисков, **Банк Креди Агриколь**



Спикеры Конференции (подтвержденные)

- **Виталий Ваврищук**, Директор Департамента финансовой стабильности, **НБУ**
- **Руслан Спивак**, Директор Корпоративного бизнеса, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Надежда Мешенко**, FRM, Начальник управления финансовых и операционных рисков, **НБУ**
- **Николай Селехман**, FRM, CFA, Заместитель Директора Департамента открытых рынков, **НБУ**, член Наблюдательного совета, **Национальный Депозитарий Украины**
- **Дмитрий Колечко**, Член Правления, Главный риск Менеджер, **VP Bank (Вьетнам)**
- **Александр Дуда**, Начальник Центра рынков капитала, **УкрСиббанк**
- **Вячеслав Озеров**, Директор Департамента Казначейства, **Банк Креди Агриколь**
- **Первин Дадашова**, FRM, Начальник управления макропруденциальной политики и исследований, **НБУ**
- **Олег Ткаченко**, Председатель Правления, **Банк «Расчетный Центр»**
- **Назар Одинаев**, Директор Департамента финансовых рисков, **Банк Креди Агриколь**
- **Алексей Сухоруков**, Директор по развитию бизнеса, **Украинская биржа**
- **Алексей Назаров**, Начальник Управления рыночных рисков и рисков финансовых институтов, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Юрий Табин**, Заместитель Директора Департамента рыночного риска и риска ликвидности, **Кредобанк**
- **Анна Рублева**, Директор Департамента управления финансовыми рисками, **ОТП Банк**
- **Ярослав Невмержицкий**, FRM, ERP, CFA, Главный Риск Менеджер, **U.Commodities**

COVID-19 и финансовый сектор: какие результаты и перспективы?

Презентация: Полгода пандемии COVID-19: результаты, уроки и прогнозы для финансового сектора

- **Виталий Ваврищук**, Директор Департамента финансовой стабильности, **НБУ**
- 1. Обзор макроэкономического состояния Украины
- 2. Обзор внешних и внутренних условий и рисков для банковского и небанковского финансового сектора
- 3. Перспективы финансовой стабильности
- 4. Регуляторные инициативы НБУ

Требования НБУ к капиталу под рыночные риски

Уже в сентябре 2020 НБУ направит банкам проект требований к определению минимальной потребности в капитале под рыночные риски в соответствии с рекомендацией Базельского комитета и задачам гармонизации с законодательством ЕС. На конференции состоится обсуждение этих требований, в котором примут участие риск менеджеры банки и представители НБУ, которые непосредственно их подготовили.

Презентация: Обзор требований НБУ к капиталу под рыночные риски.

- **Первин Дадашова**, FRM, Начальник управления макропруденциальной политики и исследований, **НБУ**
- 1. На международные стандарты опираются эти требования?
- 2. Подход к определению минимальной потребности в капитале в Валютный риск;
- 3. Подход к определению минимальной потребности в капитале в Процентный риск торговой книги;
- 4. Подход к определению минимальной потребности в капитале в Фондовый риск (Equity risk)
- 5. Подход к определению минимальной потребности в капитале в Товарный риск (Commodity risk).
- 6. Чем отличается этот подход к определению минимальной потребности в капитале в рыночный риск от того, что банки должны оценивать в рамках СУР и требований Положения №64?

Панельная дискуссия НБУ и банков - Обсуждение новых регуляторных требований к капиталу под рыночные риски.

- **Первин Дадашова**, FRM, Начальник управления макропруденциальной политики и исследований, **НБУ** (модератор)
- **Назар Одинаев**, Директор Департамента финансовых рисков, **Банк Креди Агриколь**
- **Анна Рублева**, Директор Департамента управления финансовыми рисками, **ОТП Банк**
- **Алексей Назаров**, Начальник Управления рыночных рисков и рисков финансовых институтов, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Юрий Табин**, Заместитель Директора Департамента рыночного риска и риска ликвидности, **Кредобанк**

Деривативы: от оценки к хеджированию рыночных рисков

19 июня Верховная Рада приняла, а 12 августа Президент Украины подписал Закон «О внесении изменений в некоторые законодательные акты Украины относительно упрощения привлечения инвестиций и внедрения новых финансовых инструментов» № 738-IX, который должен вступить в действие с 1 января 2021 года. Этот закон будет способствовать эффективному развитию рынков производных финансовых инструментов (деривативов). Также 19 июня НБУ утвердил изменения в Порядок оценки справедливой стоимости производных финансовых инструментов, операции с которыми осуществляет НБУ, а со 2 июля началось проведение аукционов среди коммерческих банков на заключение с НБУ процентных свопов.

С другой стороны, плавающий валютный курс и ревальвация гривни в 2019 году заставляет экспортеров и импортеров более активно использовать деривативы для хеджирования валютных рисков. Спрос на них растет. Но какие именно деривативы им доступны?

Согласно данным НБУ, если в 2019 в сумме объем продаж и покупки форвардов клиентами банков составил USD 1.5 млрд, то за первую половину этого года он достиг уже почти USD 1.2 млрд. Но все же этот объем является небольшой по сравнению со спот рынком, где за 2019 объем операций на межбанке с валютой (tod, tom и spot, без операций НБУ) был USD 84 млрд, а за полгода 2020 достиг USD 52 млрд. Кроме валютных форвардов, клиенты хотели бы использовать валютные фьючерсы, которые имеют определенные преимущества.

Но как запустить настоящий рынок валютных фьючерсов? И вообще, какой есть опыт в НБУ, банков и их клиентов в оценке и использовании деривативов для хеджирования рыночных рисков?

Презентация: Подходы НБУ к оценке деривативов

- **Надежда Мешенко**, FRM, Начальник управления финансовых и операционных рисков, **НБУ**
1. Процесс построения модели для оценки деривативов (на примере модели оценки свопа процентной ставки)
 2. Порядок валидации моделей, согласно требованиям НБУ к построению и валидации моделей (глава 14 Постановления №64)
 3. Модели, которые НБУ использует для оценки деривативов, с которыми осуществляет операции на рынке Украины.

Сессия вопросов и ответов по модели оценки и аукционах НБУ с Процентным свопом

- **Надежда Мешенко**, FRM, Начальник управления финансовых и операционных рисков, **НБУ**
- **Николай Селехман**, FRM, CFA, Заместитель Директора Департамента открытых рынков, **НБУ**, член Наблюдательного совета, **Национальный Депозитарий Украины**

Панельная дискуссия «Как, наконец, запустить рынок валютных фьючерсов?»

1. Насколько банки заинтересованы в валютных фьючерсах для собственных целей хеджирования валютных рисков?
2. Насколько клиенты банков - экспортеры и импортеры - заинтересованы в валютных фьючерсах? Или их потребности в хеджировании рисков банки закрывают форвардами? Понимают ли клиенты различия между форвардами и фьючерсами?
3. Для запуска рынка валютных фьючерсов нужна не только торговая система, но также клиринговый и расчетный механизм с надежной системой управления рисками, которому доверять НБУ, банки и их крупные экспортеры и импортеры. Какие требования у НБУ и банков к такому механизму клиринга и расчетов? Какой механизм клиринга и расчетов готовы предложить биржи?

Участники дискуссии:

- **Руслан Спивак**, Директор Корпоративного бизнеса, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Александр Дуда**, Начальник Центра рынков капитала, **УкрСиббанк**
- **Вячеслав Озеров**, Директор Департамента Казначейства, **Банк Креди Агриколь**
- **Олег Ткаченко**, Председатель Правления, **Банк «Расчетный Центр»**
- **Алексей Сухоруков**, Директор по развитию бизнеса, **Украинская биржа**

Презентация: Опыт запуска валютных и других деривативов во Вьетнаме

- **Дмитрий Колечко**, Член Правления, Главный риск Менеджер, **VP Bank (Вьетнам)**

Презентация Товарные деривативы: уроки и перспективы для украинского рынка

- **Ярослав Невмержицкий**, FRM, ERP, CFA, Главный Риск Менеджер, **U.Commodities**

Товарные деривативы формируют интерес со стороны коммерческих банков по трем основным причинам:

- a) товарные деривативы являются отдельной и инвестиционно привлекательной группой рыночных активов, которые расширяют возможности для генерирования доходов, так и для диверсификации своей экспозиции к рискованным факторам в экономике;
- b) рыночные котировки биржевых товаров (де факто товарных деривативов) используются как рыночные индикаторы макроэкономической аналитики и формирования стресс-сценариев
- c) экспозиция банка к рискам товарных рынков формируется и из-за возможного spill-over экспозиции к товарным рынкам клиентов и контрагентов банка.

В контексте упомянутых выше тем в докладе будут рассмотрены такие вопросы.

1. Ценообразование на товарных рынках: общее и отрицательное по сравнению с продуктами рынка.
2. Физическое vs финансовое исполнение товарных деривативов
3. Механизм влияния рынка деривативов на физический (спот) рынок: опыт и выводы для Украины.

В программу Конференции могут быть внесены изменения.

Информация для участников

Формат Конференции Конференция состоится в форматах **онлайн и офлайн** (с соблюдением всех карантинных и гигиенических требований).

Место проведения Конференции в формате офлайн:
Конференц-Холл ДЕПО (Киев, ул. Антоновича, 50)

Рабочий язык Конференции – украинский или русский.
Для англоязычных докладов будет предоставлен переводчик.

Стоимость участия одного представителя в работе Конференции:

для представителей организаций-резидентов Украины (грн)*	9950
для представителей организаций - нерезидентов Украины (EUR)	300

В стоимость входит:

- Участие офлайн или онлайн (на выбор) *
- Полное видео
- Презентации спикеров
- Нетворкинг (в формате офлайн)
- Кофе брейки, обед, фуршет (в формате офлайн)

* Участники имеют право изменить формат своего участия (с офлайн на онлайн или наоборот) **до 5 октября 17:00**, направив соответствующий запрос на e-mail: office@extra-consulting.net.

ВНИМАНИЕ! АКЦИЯ «1+1»:

- При оплате за одного представителя, второй представитель этой организации участвует в Конференции **БЕСПЛАТНО**.

Условия этой Акции:

- 1) Акция действует **до 25 сентября 2020** включительно.
- 2) Акция не действует с другими скидками.
- 3) Оплата за участие должна состояться до конечной даты действия этой акции.

Скидки на участие в Конференции:

Для представителей организаций, от которых есть спикеры на этой конференции	50%
Для членов GARP и UUPN	5%
Для постоянных клиентов	5%

Скидки суммируются.

Количество офлайн и онлайн мест ограничено!

Для участия в работе Конференции, пожалуйста, заполните заявку и направьте ее по e-mail: office@extra-consulting.net. При получении Вашей заявки, мы вышлем Вам счет на оплату. Форма оплаты безналичная, на текущий счет.

По вопросам маркетинговых возможностей и спонсорства, пожалуйста, обращайтесь по e-mail: marketing@extra-consulting.net.

Оргкомитет Конференции:

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



Экстра Консалтинг (www.extra-consulting.net) - ведущий провайдер в Украине семинаров, конференций и консалтинга, которая уже 19 лет реализует свою миссию в распространении среди банков и финансовых компаний Украины и СНГ лучшей мировой практики менеджмента и современных информационных технологий для повышения эффективности их работы. Компания реализует эту миссию благодаря комбинации опыта украинских и международных консультантов. Компания имеет 19-летний успешный опыт проведения профессиональных конференций и тренингов, основной темой которых является управление рисками. Компания проводит пять конференций в год: по управлению операционными рисками, кредитным риском, рыночными рисками и риском ликвидности, комплаенс риском и по управлению доходностью и рисками. Консультанты компании с успехом выполнили ряд консалтинговых проектов для банков Украины, Республики Беларусь, России, Кыргызстана, Таджикистана, Вьетнам, стран Западных Балкан и Восточного партнерства.

**ЗАЯВКА
НА УЧАСТИЕ В**

**IX Ежегодная Конференция
Управление рыночными рисками и риском ликвидности**

market|risk|2020

9 октября 2020 | Киев, Украина

Просим зарегистрировать представителей нашей организации (пожалуйста, отметьте свой выбор в [] с помощью **U** или **X**: **все поля обязательны к заполнению**):

		Какой формат участия выбираете?*
ФИО Должность Моб телефон e-mail Член UUPN [] да Член GARP [] да GARP ID _____		[] Онлайн или [] Офлайн
ФИО Должность Моб телефон e-mail Член UUPN [] да Член GARP [] да GARP ID _____		[] Онлайн или [] Офлайн

* Участники имеют право изменить формат своего участия (с оффлайн на онлайн или наоборот) **до 5 октября 17:00**, направив соответствующий запрос на e-mail: office@extra-consulting.net.

Всего стоимость _____

Название организации : _____

Укажите, пожалуйста, ниже, кому и по какому адресу нам прислать бухгалтерские документы:

На чье имя прислать документы? _____

Его контактный телефон: (_____) _____

Его e-mail: _____

Почтовый индекс: _____

Полный почтовый адрес: _____

Оплату до начала конференции гарантируем.

Руководитель _____

Заявку, пожалуйста, направьте на e-mail office@extra-consulting.net