

## X Щорічна Конференція Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності

# market|risk|2021

12 жовтня 2021 | Офлайн + Онлайн  
Версія від 13.09.21

### Про Конференцію

X Щорічна Конференція «Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності Market|Risk|2021» відбудеться 12 жовтня 2021 року у Києві, Україна.

Метою Конференції є огляд перспектив Монетарної політики НБУ в умовах прискореної інфляції, обговорення регуляторних вимог до капіталу під ринкові ризики, інновацій в управлінні ринковими ризиками та використанні для цього деривативів.

Формат Конференції: Офлайн+Онлайн.

- Як Монетарна політика НБУ реагує на прискорену інфляцію?
- Як будуть впроваджуватись вимоги НБУ до капіталу під ринкові ризики?
- Як проводити стрес тестування ринкового ризику?
- Які є Інновації в управлінні ринковими ризиками?

### Спікери Конференції



**Сергій Ніколайчук**  
Заступник  
Голови  
НБУ



**Надія Мешенко**  
FRM, Старший  
Фінансовий  
офіцер,  
Департамент  
Фінансів  
IMF



**Первін Дадашова**  
FRM  
Начальник  
управління  
макропру-  
денційної  
політики та  
досліджень  
НБУ



**Дмитро Колечко**  
Член  
Правління,  
Головний  
Ризик  
Менеджер  
VP Bank  
(В'єтнам)



**Олексій Назаров**  
Начальник  
Управління  
ринкових  
ризиків та  
ризиків  
фінансових  
інститутів  
Райфайзен  
Банк Аваль



**Ганна Рубльова**  
CFA  
Директор  
Департаменту  
управління  
фінансовими  
ризиками  
ОТП Банк



**Юрій Табін**  
Заступник  
Директора  
Департаменту  
ринкового  
ризиків та  
ризиків  
ліквідності  
Кредобанк



**Ігор Олехов**  
Партнер  
фінансової  
практики  
CMS Cameron  
McKenna



**Олег Ткаченко**  
Голова  
Правління  
Банк  
Розрахунковий  
Центр



**Ярослав Невмержицький**  
FRM, ERP, CFA  
Головний Ризик  
Менеджер  
U.Commodities

### Партнери



### 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

- «Сподобалась підготовка та проведення самої конференції» - **Валентина Никитенко**, Незалежний член Наглядової ради, **ТАСкомбанк**
- «Сподобались запрошені спікери, ризик та бізнес направленість виступів, практична користь» - **Андрій Назаренко**, Начальник управління ризиків, **АП банк**
- «Відмінний підбір спікерів та тем для обговорення», - **Тетяна Сотникова**, Член Правління, Головний ризик менеджер, **Піреус Банк**
- «Цікава, дуже актуальна тема, формат, спікери» - **Назар Одинаєв**, Директор Департаменту фінансових ризиків, **Банк Креді Агриколь**



## Спікери Конференції (підтверджені)

- **Сергій Ніколайчук**, Заступник Голови, **НБУ**
- **Надія Мешенко**, FRM, Старший Фінансовий офіцер, Департамент Фінансів, **IMF (США)**
- **Первін Дадашова**, FRM, Начальник управління макропруденційної політики та досліджень, **НБУ**
- **Дмитро Колечко**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, **VP Bank (В'єтнам)**
- **Ганна Рубльова**, CFA, Директор Департаменту управління фінансовими ризиками, **ОТП Банк**
- **Олексій Назаров**, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Юрій Табін**, Заступник Директора Департаменту ринкового ризику та ризику ліквідності, **Кредобанк**
- **Ігор Олехов**, Партнер фінансової практики, **CMS Cameron McKenna Nabarro Olswang**, Співголова, Комітет з питань банківських та фінансових послуг Американської торговельної палати в Україні
- **Олег Ткаченко**, Голова Правління, **Розрахунковий Центр**
- **Ярослав Невмержицький**, FRM, ERP, CFA, Головний Ризик Менеджер, **U.Commodities**

Очікуються підтвердження від інших спікерів!

### Монетарна політика НБУ в умовах прискореної інфляції

#### Презентація: Монетарна політика НБУ: реакція на прискорення інфляції

- **Сергій Ніколайчук**, Заступник Голови, **НБУ**
  1. Перспективи макроекономічного розвитку України та Монетарної політику НБУ
  2. Прискорення інфляції у світі та в Україні та її вплив на макроекономіку та ризики фінансової системи.
  3. Виклики і ризики для країни, можливі зовнішні і внутрішні шоки, їх вплив на банківський і фінансовий сектор України.

### Вимоги НБУ до капіталу під ринкові ризики

#### Презентація: Вимоги НБУ до капіталу під ринкові ризики. Приклади застосування.

- **Первін Дадашова**, FRM, Начальник управління макропруденційної політики та досліджень, **НБУ**
  1. Огляд останніх змін та ключових вимог до капіталу під ринковий ризик
  2. Приклади розрахунку капіталу згідно нових вимог НБУ по основних фінансових інструментах - Репо, Зворотній репо, Своп, Форвард.

#### Панельна дискусія НБУ та банків – Обговорення оновлених регуляторних вимог до капіталу під ринкові ризики.

1. Які плани/наміри щодо утримання торгової книги у вашому банку та в системі загалом?
2. Як би Ви оцінили ринкові ризики, які із них вбачаєте більш/менш вагомими?
3. Якщо НБУ надасть можливість банкам із невеликими торговими книгами не розраховувати окремо капітал під ринковий ризик, а лише окремі складові, чи розробляли би ви у банку повноцінну оцінку ринкового ризику?
4. Які типи інструментів утримуєте у торговій книзі, за якими із них можуть бути складнощі із оцінкою ринкового ризику?
5. Які підходи до стрес-тестування ринкового ризику використовуєте?

#### Спікери:

- **Первін Дадашова**, FRM, Начальник управління макропруденційної політики та досліджень, **НБУ** (модератор)
- **Ганна Рубльова**, CFA, Директор Департаменту управління фінансовими ризиками, **ОТП Банк**
- **Олексій Назаров**, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Юрій Табін**, Заступник Директора Департаменту ринкового ризику та ризику ліквідності, **Кредобанк**

### Інновації у управлінні ринковими ризиками

#### Презентація: Зміни в практиках управління ринковими ризиками, пов'язані з пандемією COVID-19.

- **Надія Мешенко**, FRM, Старший Фінансовий офіцер, Департамент Фінансів, **IMF**
- Пандемія COVID-19 суттєво вплинула на світові фінансові ринки і змінила ринкові ризики. Відповідно змінюються й практики управління цими ризиками. У своїй презентації Надія, яка вже більше року є членом місії МВФ у різних країнах, підсумує основні зміни, що вже відбулися та ще очікуються.

**Презентація: Перевірка угод на відповідність ринковими цінами та валідація ринкових даних: досвід ВП Банк (В'єтнам)**

- **Дмитро Колечко**, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, VP Bank (В'єтнам)

Зазвичай казначейські операції є одними з найскладніших в банківській справі. Казначейство має доступ до великих фінансових ресурсів, розмір окремих угод в сотні разів більше операцій інших бізнес-підрозділів банку. Це означає, що і вимоги до управління ризиками такого підрозділу є особливо високі. У своїй презентації Дмитро поділиться досвідом в побудові системи порівняння угод Казначейства з ринком і розповість, як відбувається валідація ринкових даних на прикладі VP Bank.

**Презентація: Деривативи: Питання правового статусу в Україні та документування**

- **Ігор Олехов**, Партнер фінансової практики, CMS Cameron McKenna Nabarro Olswang, Співголова, Комітет з питань банківських та фінансових послуг Американської торговельної палати в Україні

1. Регулювання деривативів за Законом 738-ІХ
2. Валютні обмеження, Ліквідаційний неттінг, Остаточність розрахунків
3. Документування для деривативів

**Презентація: Коли та як використовувати Процентний Своп для хеджування Процентного Ризику?**

**Приклади**

- **Ярослав Невмержицький**, FRM, ERP, CFA, Головний Ризик Менеджер, U.Commodities
1. Ризиковий профіль свопу як фінансового контракту.
  2. Коли та як (і чому) використовувати своп для хеджування ринкового ризику?
  3. Контроль ризику vs хеджування ризику.
  4. Погляд на хеджування ринкового ризику з використанням свопу крізь призму концепції первинний-залишковий-вторинний ризик.
  5. Базовий ризик хеджування на прикладі процентного свопу: драйвери та візуалізація його динаміки/механіки.

**Презентація: Ринок Repo та перспективи запуску ринку Валютних Свопів. Роль Центрального контрагента для управління ризиками та гарантування угод**

- **Олег Ткаченко**, Голова Правління, Розрахунковий Центр

Дізнайтесь, як працює ринок Repo, та яка роль Центрального контрагента для управління ризиками та гарантування угод на цьому ринку, а також коли та як саме банки зможуть активно торгувати Валютними свопами.

*До програми Конференції можуть бути внесені зміни.*

## Інформація для учасників

**Формат Конференції:** Конференція відбудеться у форматах **онлайн та офлайн** (з дотриманням усіх карантинних та гігієнічних вимог).

**Місце проведення Конференції у форматі офлайн:** 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:

Участь офлайн - для резидентів України (грн)	12950
Участь офлайн - для нерезидентів України (EUR)	450
Участь онлайн - для резидентів України (грн)	9950
Участь онлайн - для нерезидентів України (EUR)	350

У вартість входить:

- § Участь офлайн чи онлайн (на вибір)\*
- § Презентації спікерів
- § Нетворкінг (у форматі офлайн)
- § Кава брейки, обід, фуршет (у форматі офлайн)

\*Учасники офлайн мають **право змінити** формат своєї участі (з офлайн на онлайн) **до 8 жовтня 2021 15:00**, надіславши відповідний запит на e-mail: [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net). Різниця у вартості при цьому не повертається.

У вартість участі не входить:

- Відеозапис конференції – його можна замовити додатково до участі або без участі у Конференції.

Відеозапис конференції	Додатково до участі	Без участі
для резидентів України (грн)	5950	9950
для нерезидентів України (EUR)	200	350

**Знижки на участь у Конференції:**

Для 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»:**

§ При оплаті участі за одного представника другий представник цієї організації бере участь у Конференції **БЕЗКОШТОВНО**.

**Умови цієї Акції:**

- 1) Акція діє **до 24 вересня 2021** включно.
- 2) Другий учасник має вибрати той же формат участі (онлайн чи офлайн), що і перший.
- 3) Акція діє для замовлення відеозапису тільки додатково до участі у Конференції
- 4) Акція не діє з іншими знижками.
- 5) Оплата за участь має відбутися до кінцевої дати дії цієї акції.

Інша Акція	Дедлайн акції
Акція «1+» - другий учасник зі знижкою 50%	1 жовтня 2021

**Для участі у роботі Конференції**, будь ласка, заповніть заявку і надішліть її на e-mail: [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net). При отриманні Вашої заявки ми надішлемо Вам рахунок на оплату. Форма оплати безготівкова, на поточний рахунок.

**З питань маркетингових можливостей та спонсорства**, будь ласка, звертайтеся за e-mail: [marketing@extra-consulting.net](mailto:marketing@extra-consulting.net).

Якщо у Вас є питання, будь ласка, напишіть нам на email [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net) або зателефонуйте нам +38 (099) 741 95 73.

**Оргкомітет Конференції:**

компанія «Екстра Консалтинг»

тел.: +38 (099) 741 95 73

e-mail: [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net)

сайт: [www.extra-consulting.net](http://www.extra-consulting.net)

## Про організатора

**20** YEARS EXTRA consulting

**Екстра Консалтинг** ([www.extra-consulting.net](http://www.extra-consulting.net)) – провідний провайдер в Україні семінарів, конференцій та консалтингу, який вже **20 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, фокусуючись на ризик менеджменті. Додатково до семінарів, компанія проводить п'ять конференцій на рік: з управління операційними ризиками, кредитним ризиком, ринковими ризиками та ризиком ліквідності, комплаєнс ризиком та з управління доходністю та ризиками. Консультанти компанії з успіхом виконали ряд консалтингових проектів для банків України, Республіки Білорусь, Росії, Киргизстану, Таджикистану, В'єтнаму, країн Західних Балкан та Східного Партнерства.

Детальна інформація на сайті [www.extra-consulting.net](http://www.extra-consulting.net) або за тел. +380 99 741 95 73

ЗАЯВКА  
НА УЧАСТЬ

X Щорічна Конференція  
Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності

# market|risk|2021

12 жовтня 2021 | Київ, Україна

Просимо зареєструвати представників нашої організації  
(будь ласка, позначте свій вибір у  за допомогою **U** або **X**: **усі поля обов'язкові**):

		Який формат участі?*	Бажаєте отримати відеозапис Конференції?
<b>ПІБ</b>  <b>Посада</b> <b>Моб телефон</b> <b>e-mail</b> <b>Член UUPN</b> <b>Член GARP</b>	<input type="checkbox"/> так <input type="checkbox"/> так GARP ID _____	<input type="checkbox"/> Онлайн чи <input type="checkbox"/> Офлайн	<input type="checkbox"/> Так, участь з відеозаписом чи <input type="checkbox"/> Ні, участь без відеозапису
<b>ПІБ</b>  <b>Посада</b> <b>Моб телефон</b> <b>e-mail</b> <b>Член UUPN</b> <b>Член GARP</b>	<input type="checkbox"/> так <input type="checkbox"/> так GARP ID _____	<input type="checkbox"/> Онлайн чи <input type="checkbox"/> Офлайн	<input type="checkbox"/> Так, участь з відеозаписом чи <input type="checkbox"/> Ні, участь без відеозапису

\*Учасники офлайн мають право змінити формат своєї участі (з офлайн на онлайн) до 8 жовтня 2021 15:00, надіславши відповідний запит на e-mail: [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net).

Усього вартість \_\_\_\_\_

Назва організації: \_\_\_\_\_

Вкажіть, будь ласка, нижче, кому та на яку адресу нам надіслати бухгалтерські документи:

На ім'я якої особи надіслати документи? \_\_\_\_\_

Її контактний телефон: (\_\_\_\_) \_\_\_\_\_ її e-mail: \_\_\_\_\_

Оплату до початку конференції гарантуємо.

Керівник \_\_\_\_\_

**Заявку, будь ласка, надішліть на e-mail [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net)**

**Детальна інформація на сайті [www.extra-consulting.net](http://www.extra-consulting.net) або за тел. +380 99 741 95 73**