

VIII Щорічна Конференція  
Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності

# market|risk|2019

9 жовтня 2019 | Київ, Україна

## ПОСТ-РЕЛІЗ



9 жовтня 2019 року у Києві з успіхом пройшла VIII Щорічна Конференція «Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності Market|Risk|2019». Конференція зібрала більше 80-ти банкірів та фінансистів для обговорення макроекономічних перспектив та Монетарної Політики НБУ, а також обміну досвідом щодо кращої практики в управлінні ризиками ліквідності, процентного ризику та ринкових ризиків.



На відкритті Конференції виступив **Дмитро Сологуб**, Заступник голови Національного банку України, який поділився своїм баченням щодо перспектив макроекономічного розвитку України, зробив огляд викликів і ризиків для країни, можливих зовнішніх і внутрішніх шоків, та їх впливу на банківський і фінансовий сектор України, та презентував превентивні дії НБУ по цим ризикам, що включає його Монетарну політику та підготовку Стратегії розвитку фінансового сектору України до 2025 року.

*«Сподобалося, що на конференції були залучені до діалогу як представники комерційних банків, так і Регулятора» - Тарас Кравець, Фінансовий директор, Банк Альянс*

Після цього відбулась панельна дискусія за участю **Олени Коробкової**, Виконавчого директора НАБУ, **Сергія Ніколайчука**, Заступника міністра розвитку економіки, торгівлі та сільського господарства, **Юрія Блащука**, Незалежного члена Наглядової Ради Укргазбанку, **Ганни Самаріної**, Заступника Голови Правління (з питань фінансів) ПриватБанку та **Тараса Проць**, Члена Правління, Головного Ризик Менеджера ОТП Банку. На ній були розглянуті питання як Наглядова рада та Правління вже повинні підготувати свій банк до можливих зовнішніх та внутрішніх макро шоків.



Цього року НБУ ініціював впровадження NSFR (чистий стабільний коефіцієнт фінансування) в українських банках як частину комплексної програми посилення управління ризиками. NSFR є одним із ключових інструментів для вимірювання ризику ліквідності в банках згідно з Базелем 3.

**Віталій Ваврищук**, директор департаменту фінансової стабільності Національного банку України, презентував позицію регулятора щодо моделі NSFR та взяв участь у панельній дискусії з питань її впровадження разом з **Тетяною Сотниковою**, Членом Правління, Головний Ризик Менеджер Піреус Банку МКБ, **Ганою Рубльовою**, Начальником Управління активами і пасивами та контролінгу Казначейства ОТП Банку та **Олексієм Назаровим**, Начальником Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів Райффайзен Банку Аваль.

*«Присутність та адекватний зворотній зв'язок від Регулятора, можливість дискусії з представниками інших банків» - Андрій Грігель, тво Голови Правління, РАДОБАНК*



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. На початку Панельної дискусії з цього питання **Надія Мешенко**, Начальник управління фінансових та операційних ризиків НБУ, презентувала плани НБУ щодо впровадження вимог до капіталу щодо кредитного, операційного та ринкових ризиків. Після чого **Олексій Назаров**, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів Райффайзен Банку Аваль, детально ознайомив з підходом свого банку до розрахунку та розподілу капіталу для ринкових ризиків відповідно до внутрішньої політики, що відповідає правилам ЄС. До нього приєдналися та презентували підходи своїх банків по цій темі **Назар Одинаєв**, Директор Департаменту фінансових ризиків Банку Креді Агриколь, та **Юрій Табін**, Заступник Директора Департаменту ринкового ризику та ризику ліквідності Кредобанку

*«Високий рівень організації, підбір спікерів, актуальність тем» - Анастасія Гаврилюк, Директор з міжнародних зав'язків, Українська асоціація інвестиційного бізнесу*



Серед моделей оцінки ринкових ризиків модель GARCH виглядає як оптимальний компроміс між складністю, інформаційними потребами, інтерпретацією та точністю. НБУ у своєму Положенні №64 закликає банки використовувати її в управлінні ринковими ризиками, але хтось її випробував? На Конференції **Ярослав Невмержицький**, заступник директора з ризиків Нафтогазу, розповів, як використовувати GARCH для оцінки ринкових ризиків. Він представив, як інтерпретувати параметри базової моделі GARCH та проаналізував оцінку ефективності (валідацію) цієї моделі.



*«Зазначу швидке та ефективно занурення в різнопланові аспекти ризик-менеджменту» - Андрій Фоменко, Директор з досліджень, Група DCH*

Згідно з Положенням НБУ №64 українські банки повинні впровадити та автоматизувати цілу низку моделей оцінки та управління ризиками відповідно до вимог ЄС. **Юлія Шевчук**, FRM, консультант з управління ризиками компанії Finastra, представила, як всі моделі ризику можна інтегрувати разом в рамках однієї платформи - Finastra Fusion Risk.



Ексклюзивний Партнер Конференції з Ризик Менеджменту - компанія [Finastra](#).

Партнери Конференції - Правекс Банк, Піреус банк, Україно-Британська Професійна Асоціація (UUPN).

Інформаційні Партнери Конференції – Незалежна Асоціація Банків України (НАБУ), Всеукраїнська Асоціація Фінансових Компаній (VAFK), Українська асоціація Інвестиційного Бізнесу (UAIB).

Для замовлення матеріалів Конференції, будь ласка, звертайтеся до організатора Конференції компанії «Екстра Консалтинг» за тел (044) 227 81 73 або e-mail: [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net), веб сайт компанії [www.extra-consulting.net](http://www.extra-consulting.net).

#### Про організатора

**EXTRA**  
consulting

**Екстра Консалтинг** ([www.extra-consulting.net](http://www.extra-consulting.net)) – провідний провайдер в Україні семінарів, конференцій та консалтингу, яка вже 19 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 та провівши вже більш ніж 500 семінарів, в яких взяло участь понад 6000 слухачів, основна частина яких - представники вищого та середнього менеджменту. Компанія проводить п'ять конференцій на рік: з управління операційними ризиками (березень), кредитним ризиком (червень), ринковими ризиками та ризиком ліквідності (жовтень), комплаєнс ризиком (листопад) та з управління доходності та ризиками (грудень). Консультанти компанії з успіхом виконали ряд консалтингових проектів для банків України, Республіки Білорусь, Росії, Киргизстану, Таджикистану, В'єтнаму, країн Західних Балкан та Східного Партнерства.