

Data: 31 lipca 2019 roku (środa)

Miejsce: Centrum Konferencyjno-Szkoleniowe UOKiK (vis-a-vis hotelu Gromada),
pl. Powstańców Warszawy 1, Warszawa

Organizator: Urząd Komisji Nadzoru Finansowego

Cel

Celem seminarium jest omówienie obowiązujących i aktualnie wdrażanych regulacji oraz metod pomiaru ryzyka płynności i ryzyka stopy procentowej w księdze bankowej mających zastosowanie w banku spółdzielczym.

Kto powinien wziąć udział?

Seminarium skierowane jest do pracowników banków spółdzielczych odpowiedzialnych za pomiar i monitorowanie ryzyka płynności oraz ryzyka stopy procentowej w księdze bankowej.

Forma

Seminarium będzie miało formę prezentacji połączonej z dyskusją.

Harmonogram czasowy

Rejestracja uczestników na seminarium rozpocznie się od godziny **9.30**

Rozpoczęcie seminarium o godzinie **10.00**

Seminarium zakończy się o godzinie **16.00**

Zgłoszenia: liczba miejsc ograniczona

Zgłoszenia będą przyjmowane wyłącznie za pośrednictwem elektronicznego formularza zgłoszeniowego dostępnego pod adresem www.knf.gov.pl w dziale „CEDUR” aż do wyczerpania miejsc. Potwierdzenia uczestnictwa zostaną przesłane najpóźniej w dniu **26 lipca 2019 r.**

Kontakt:

Aleksandra Leśniak, tel. 22 262 53 28

Paweł Panicz, tel. 22 262 56 83

cedur@knf.gov.pl

Oplaty

Udział w seminarium jest bezpłatny. Uczestnicy otrzymają materiały konferencyjne.

PROGRAM

31 lipca 2019 r. (środa)

**Centrum Konferencyjno-Szkoleniowe UOKiK (vis-a-vis hotelu Gromada),
pl. Powstańców Warszawy 1, Warszawa**

Prelegent: Anna Kuligowska

Ekspert

Departament Rozwoju Regulacji

Urząd Komisji Nadzoru Finansowego

Godzina	Temat
9:30-10:00	Rejestracja uczestników i bufet kawowy
10:00-12:00	Zarządzanie ryzykiem płynności – główne regulacje krajowe i międzynarodowe - Rekomendacja P - Uchwała KNF 386/2008 - Rozporządzenie MRiF z 6 marca 2017 r. - Standardy BCBS - CRD IV/CRR wraz z RTS i ITS - Akt Delegowany EU 2015/61 z nowelizacją - CRD V/CRR II
12:00-12:30	Przerwa na kawę
12:30-13:30	Zarządzanie ryzykiem płynności w praktyce - Podział kompetencji vs horyzont pomiaru - Metody pomiaru, m.in. luka płynności, stabilność bazy depozytowej, wskaźniki wewnętrzne
13:30-13:45	Przerwa na kawę

13:45-15:45	Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w księdze bankowej ▪ Główne regulacje krajowe i międzynarodowe ▪ Rekomendacja G ▪ Rozporządzenie MRiF z 6 marca 2017 r. ▪ Standardy BCBS ▪ Wytoczne EBA ▪ Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w księdze bankowej w praktyce ▪ Instrumenty finansowe generujące ryzyko stopy procentowej ▪ Metody pomiaru, m.in. luka przeszacowania, BPV, VaR, miary ryzyka bazowego i opcji klienta, inne miary
15:45-16:00	Pytania i dyskusja