

О Конференции

VIII Ежегодная Конференция «Управление рыночными рисками и риском ликвидности Market|Risk|2019» состоится 9 октября 2019 в Киеве, Украина.

Целью Конференции является обзор макроэкономических перспектив и Монетарной политики НБУ, а также обмен опытом по лучшей практике в управлении рисками ликвидности, процентного риска и рыночных рисков в рамках задач, стоящих перед банками в Постановлении НБУ №64, и в рамках перспективного регулирования.

- Доклад НБУ про макроэкономические перспективы и Монетарную Политику
- Уникальные панельные дискуссии относительно макроэкономических шоков, внедрения показателя NSFR и капитала под рыночные риски
- Презентации ведущих экспертов по практике управления риском ликвидности и рыночными рисками

Спикеры Конференции



Дмитро Сологуб
Заступник
Голови
НБУ



Юрий Блащук
Независимый
член
Наблюдатель
ного Совета
Укргазбанк



Тарас Проць
Член
Правления,
Главный Риск
Менеджер
ОТП Банк



Татьяна Сотникова
Член
Правления,
Главный Риск
Менеджер
Пиреус
Банк МКБ



Сергей Николайчук
Заместитель
министра
экономики



Виталий Ваврищук
Директор
департамента
финансовой
стабильности
НБУ



Анна Самарина
Заместитель
Председателя
Правления (по
вопросам
финансов)
ПриватБанк



Алексе́й Шкляру́к
Член
Правления,
Главный Риск
Менеджер
Агро-
просперис
Банк



Елена Коробкова
Исполни-
тельный
директор
НАБУ



Игорь Будник
Экс
Директор
Департамента
управления
рисками
НБУ



Анна Рублева
Начальник
Управления
активами и
пассивами и
контроллинга
Казначейства
ОТП Банк



Алексе́й Назаров
Начальник
Управления
рыночных
рисков и
рисков
финансовых
институтов
Райффайзен
Банк Аваль



Марина Семенец
Руководитель
управления
рыночными
рисками
ПриватБанк



Ярослав Невмержицкий
FRM
ERP CFA
Заместитель
Главного
Риск
менеджера
Нафтогаз
Украины



Юлия Шевчук
FRM
Консультант
по
управлению
рисками
Finastra

Эксклюзивный Партнер по Риск Менеджменту



Партнеры



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**
- «Отличный подбор спикеров и тем для обсуждения», — **Татьяна Сотникова**, Член Правления, Главный риск менеджер, **Пиреус Банк**
- «Возможность обсудить открытые вопросы с коллегами во время перерывов, отличная общая организация и тематика докладов», — **Надежда Мещенко**, Начальник управления рыночных рисков, **Укрсоцбанк**
- «Спасибо за возможность обсудить с коллегами из других банков актуальные проблемы и методы их решения», — **Ярослав Стецик**, Начальник отдела интегрированных и рыночных рисков, **Сбербанк России**



Спикеры Конференции (подтвержденные)

- **Дмитрий Сологуб**, Заместитель Главы, **НБУ**
- **Сергей Николайчук**, Заместитель министра, **Министерство развития экономики, торговли и сельского хозяйства**
- **Юрий Блащук**, Независимый член Наблюдательного Совета, **Укргазбанк**
- **Тарас Проць**, Член Правления, Главный риск менеджер, **ОТП Банк**
- **Анна Самарина**, Заместитель Председателя Правления (по вопросам финансов), **ПриватБанк**
- **Татьяна Сотникова**, Член Правления, CRO, **Пиреус Банк МКБ**
- **Алексей Шклярчук**, член Правления, Главный Риск Менеджер, **Агропросперис Банк**
- **Виталий Ваврищук**, Директор Департамента финансовой стабильности, **НБУ**
- **Елена Коробкова**, Исполнительный директор, **НАБУ**
- **Назар Одинаев**, Директор Департамента финансовых рисков, **Банк Креди Агриколь**
- **Марина Семенец**, Руководитель управления рыночными рисками, **ПриватБанк**
- **Игорь Будник**, экс-Директор Департамента управления рисками, **НБУ**, Член Управляющего Комитета, **GARP Ukraine**
- **Анна Рублева**, Начальник Управления активами и пассивами и контроллинга Казначейства, **ОТП Банк**
- **Алексей Назаров**, Начальник Управления рыночных рисков и рисков финансовых институтов, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Ярослав Невмержицкий**, FRM, ERP, CFA, Заместитель Главного Риск менеджера, **Нафтогаз Украины**
- **Юрий Табин**, Заместитель Директора Департамента рыночного риска и риска ликвидности, **Кредобанк**
- **Юлия Шевчук**, FRM, Международный консультант по управлению рисками, **Finastra**

Программа Конференции

0830-0900 Регистрация участников. Приветственный кофе.

0900-0910 Открытие Конференции

Сессия: Макроэкономика и банковский и финансовый сектор Украины

0910-1000 Презентация. Перспективы макроэкономического развития Украины и Монетарная политика НБУ

- **Дмитрий Сологуб**, Заместитель Главы, НБУ
- Перспективы макроэкономического развития Украины
- Обзор вызовов и рисков для страны, возможных внешних и внутренних шоков, их влияние на банковский и финансовый сектор Украины
- Превентивные действия НБУ по этим рискам, включая его Монетарную политику и текущее и перспективное регулирования.

1000-1130 Панельная дискуссия. Макроэкономические риски и их влияние на банковскую систему Украины. Как к этому готовить свой банк уже сейчас?

- Какие макроэкономические риски внутреннего и внешнего характера? Рецессия мировой экономики? Отток капитала из Украины? Поведение нерезидентов на рынке ОВГЗ? Интенсивная трудовая миграция из Украины? Остальные?
- Как они могут повлиять на риски банковского и финансового сектора?
- Как Наблюдательный Совет и Правление банка должны уже сейчас подготовить свой банк к этому?

Участники панельной дискуссии:

- **Елена Коробкова**, Исполнительный директор, НАБУ (модератор)
- **Сергей Николайчук**, Заместитель министра, Министерство развития экономики, торговли и сельского хозяйства
- **Юрий Блащук**, Независимый член Наблюдательного Совета, Укргазбанк
- **Анна Самарина**, Заместитель Председателя Правления (по вопросам финансов), ПриватБанк
- **Тарас Проць**, Член Правления, Главный риск менеджер, ОТП Банк

1130-1200 Кофе брейк

Сессия: Реализация Постановления НБУ №64 по риску ликвидности и рыночным рискам

1200-1230 Презентация. Коэффициент стабильного финансирования NSFR. Опыт внедрения ОТП банка.

- **Анна Рублева**, Начальник Управления активами и пассивами и контроллинга Казначейства, ОТП Банк
- Введение: взвешенная структура пассивов банков как залог устойчивости системы - основной мотив введения NSFR Базельским комитетом по банковскому надзору
- Структура активов - определяющий фактор потребностей в стабильном финансировании; сравнения подходов Базеля и предложений НБУ;
- Сравнение подходов Базеля и предложений НБУ по определению имеющегося стабильного финансирования. Опыт ОТП Банка относительно стабильности клиентских остатков.

1230-1330 Панельная дискуссия. Коэффициент стабильного финансирования NSFR для банков Украины
Открытые вопросы по проекту НБУ методики расчета NSFR от 12.03.2019:

- Общие вопросы. Как часто будет осуществляться мониторинг соблюдения NSFR? Европейская практика - ежеквартально. Предусматриваются повышенные требования по NSFR для системно важных банков?
- Расчет NSFR будет осуществляться в разрезе отдельных валют, а лимит касаться стабильного финансирования в целом? Как определить валюту стабильного финансирования для валютных ОВГЗ, которые участвуют в расчете LCR в гривне?
- Почему депозитные сертификаты НБУ получают высшие RSF по сравнению с ОВГЗ, если они HQLA?
- Операции обратного репо с НБУ получили 10-15% RSF по сравнению с подходом Базеля, предусматривающий RSF?

- Как определить RSF для овердрафтов и других продуктов с досрочным погашением?
- Сроки погашения активов определяются на основе контрактных денежных потоков с учетом опциональности?
- Предложения по учету деривативов в расчет NSFR по справедливой стоимости с возможностью зачисления встречных требований с одним контрагентом
- Внебалансовый залог, что является HQLA и полученный по операциям репо с переходом права собственности, учитываем как обремененный актив?

Участники панельной дискуссии:

- **Виталий Ваврищук**, Директор Департамента финансовой стабильности, **НБУ (модератор)**
- **Татьяна Сотникова**, Член Правления, CRO, **Пиреус Банк МКБ**
- **Алексей Шклярчук**, член Правления, Главный Риск Менеджер, **Агропросперис Банк**
- **Анна Рублева**, Начальник Управления активами и пассивами и контроллинга Казначейства, **ОТП Банк**
- **Алексей Назаров**, Начальник Управления рыночных рисков и рисков финансовых институтов, **Райффайзен Банк Аваль**

1330-1430 **Ланч**

1430-1500 **Презентация. Внедрение Плана финансирования в кризисных ситуациях. Опыт ПриватБанка.**

- **Марина Семенец**, Руководитель управления рыночными рисками, **ПриватБанк**
- Определение количественных и качественных индикаторов кризиса ликвидности с применением подхода светофора.
- Построение процесса мониторинга индикаторов кризиса ликвидности и настройка эскалации нарушений показателей.
- Управление ликвидностью в период кризиса. Определение перечня мероприятий по восстановлению ликвидности в период кризиса.

1500-1530 **Презентация. Использование модели GARCH для оценки рыночных рисков.**

- **Ярослав Невмержицкий**, FRM, ERP, CFA, Заместитель Главного Риск менеджера, **Нафтогаз Украины**
- Выбор метода определения цены рыночного риска. Обзор методов моделирования. На сколько они адекватно оценивают цену риска (демонстрация результатов оценки лимита различными методами, в том числе и предусмотренными в Постановлении НБУ №64 (исторический, параметрический, сценарный по Монте-Карло, (G) ARCH))?
- GARCH как оптимальный компромисс между сложности, информационных потребностей, interpretability и точностью. А как насчет прогнозирования на основе GARCH?
- Как интерпретировать параметры базовой (vanila) GARCH модели. GARCH vs EWMA: сходства и различия.
- Оценки эффективности (валидация) GARCH модели - пробои, переоценка / недооценка рыночного риска.
- Выявление слабых мест vanila GARCH и способы ее устранения.

1530-1600 **Презентация. Тема уточняется.**

- **Юлия Шевчук**, FRM, Международный консультант по управлению рисками, **Finastra**

1600-1630 **Кофе брейк**

Сессия: Перспективное регулирования НБУ: Распределение капитала под рыночные риски

НБУ планирует внедрить регуляторные требования по аллокации капитала под рыночные риски. Поэтому для НБУ и банков важно уже сейчас изучить опыт того, как происходит расчет и аллокация капитала под рыночные риски в соответствии с требованиями ЕС.

1630-1700 **Презентация. Расчет и аллокация капитала под рыночные риски. Опыт Райффайзен банка Аваль.**

- **Алексей Назаров**, Начальник Управления рыночных рисков и рисков финансовых институтов, **Райффайзен Банк Аваль**
- Система расчета капитала под рыночные риски: Как мы рассчитываем сумму капитала под рыночные риски? Какие инструменты и модели используются для этого?
- Как сделать эту систему практичной в процессе принятия решений в банке?

- Бюджетирование капитала: Как нужно внедрять аллокации капитала под рыночные риски в бюджетный процесс банке?
- Как мотивировать бизнес к управлению рыночными рисками? Организационные вопросы управления рыночными рисками: определение бизнес-владельца риска, настройка мотивации к управлению рыночными рисками, соблюдения бюджетных показателей, разумное реагирования на отклонения от нормы, культура и отношение риск-менеджера.

1700-1800 Панельная дискуссия: Внедрение модели расчета и аллокации капитала под рыночные риски.

Участники панельной дискуссии:

- **Игорь Будник**, экс-Директор Департамента управления рисками, **НБУ**, Член Управляющего Комитета, **GARP Ukraine (модератор)**
- **Алексей Назаров**, Начальник Управления рыночных рисков и рисков финансовых институтов, **Райффайзен Банк Аваль**
- **Назар Одинаев**, Директор Департамента финансовых рисков, **Банк Креди Агриколь**
- **Юрий Табин**, Заместитель Директора Департамента рыночного риска и риска ликвидности, **Кредобанк**

1800-1810 Заккрытие Конференции

1810-1930 Фуршет

В программу Конференции могут быть внесены изменения

Информация для участников

Место проведения Конференции: 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:

	Конференция (9 октября 2019)
для представителей организаций-резидентов Украины (грн)*	8950
для представителей организаций - нерезидентов Украины (EUR)	300

*без НДС, единый налог

В стоимость входят материалы, обед, кофе брейки, фуршет.

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.

ВНИМАНИЕ! АКЦИЯ «1+»:

- **Для банков и финансовых организаций:** При оплате за одного представителя, второй представитель этой организации участвует в Конференции **СО СКИДКОЙ 60%**.
- **Для остальных организаций:** При оплате за одного представителя, второй представитель этой организации участвует в Конференции **СО СКИДКОЙ 40%**.

Условия этой Акции:

- 1) Акция действует **до 25 сентября 2019** включительно.
- 2) Акция не действует с другими скидками.
- 3) Оплата за участие должна состояться до конечной даты действия этой акции.

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.

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

Об организаторе

EXTRA
consulting

Экстра Консалтинг (www.extra-consulting.net) – ведущий провайдер в Украине банковских семинаров, конференций и консалтинга, которая уже 18 лет реализует свою миссию в распространении среди банков и финансовых компаний Украины и СНГ наилучшей мировой практики менеджмента и современных информационных технологий для улучшения эффективности их работы. Компания реализует эту миссию благодаря комбинации опыта украинских и международных консультантов, проведя, начиная с 2000 года, уже около 500 семинаров, в которых приняло участие более 6,000 слушателей, основная часть которых – представители высшего и среднего менеджмента. Компания проводит четыре конференции в год – по управлению операционными рисками (март), кредитным риском (июнь), рыночными рисками и риском ликвидности (октябрь) и управлению доходностью и рисками (декабрь). Консультанты компании с успехом выполнили ряд консалтинговых проектов в таких странах: Украина, Республика Беларусь, Россия, Кыргызстан, Таджикистан, Вьетнам, в странах Западных Балкан и Восточного Партнерства.

О Finastra



Предлагая открытые инновационные ИТ-платформы, Finastra помогает в максимальной степени раскрывать как личностный, так и предпринимательский потенциал в сфере финансов. Образованная в 2017 году слиянием компаний Misys и D+H, компания Finastra предлагает широчайший спектр финансовых программных решений в мире на сегодняшний день — в том числе системы для поддержки розничного банкинга, транзакционного банкинга, кредитования, а также казначейства и рынков капитала. Решения Finastra позволяют клиентам внедрять и использовать критически важные технологии как на своих площадках, так и в облаке. Масштаб и географический диапазон деятельности компании подтверждают способность Finastra осуществлять эффективное обслуживание клиентов вне зависимости от их размера или местоположения — будь то глобальные финансовые институты или региональные банки и кредитные союзы. Благодаря открытым, безопасным и надежным решениям клиенты Finastra обретают возможность ускорить темпы роста бизнеса, оптимизировать затраты, снизить риски и постоянно совершенствовать свой продуктовый портфель в соответствии с динамично меняющимися потребностями клиентов. Технологиями Finastra пользуются 48 из 50 крупнейших банков мира. Посетите наш сайт: finastra.com.

ЗАЯВКА
НА УЧАСТИЕ В

VIII Ежегодная Конференция
Управление рыночными рисками и риском ликвидности

market|risk|2019

9 октября 2019 | Киев, Украина

Просим зарегистрировать представителей нашей организации
(пожалуйста, отметьте свой выбор в [] с помощью V или X):

ФИО Должность e-mail Член UUPN Член GARP	[] да [] да Если «да», укажите GARP ID _____
ФИО Должность e-mail Член UUPN Член GARP	[] да [] да Если «да», укажите GARP ID _____

Всего стоимость _____

Название организации : _____

Адрес: _____

Контактное лицо: _____

Контактный телефон: (____) _____

По какому E-mail отправить счет: _____

Оплату до начала конференции гарантируем.

Руководитель _____

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