

## МЕТЕРІАЛИ КОНФЕРЕНЦІЇ (ВІДЕО + ПРЕЗЕНТАЦІЇ)

9 жовтня 2020 у Києві з успіхом відбулась IX Щорічна Конференція «Управління ринковими ризиками Market|Risk|2020». В її роботі взяло участь майже 100 учасників. Конференція пройшла онлайн.

Метою Конференції був огляд макроекономічних перспектив та ризиків для фінансового сектору в умовах COVID-19, обговорення регуляторних вимог до капіталу під ринкові ризики, а також обмін досвідом щодо кращої практики в оцінці деривативів та їх використанні для хеджування ринкових ризиків банками та їх клієнтами.

На конференції виступили 20 спікерів - представників НБУ та керівників ризиків комерційних банків.

Дякуємо всім нашим спікерам, учасникам та нашим Партнерам Конференції:

Партнери - Правекс Банк, Піреус Банк, UUPN

Інформаційні Партнери – НАБУ, УАІБ.

**Для тих, хто не мав можливості взяти участь у Конференції**, пропонуємо замовити її комплект матеріалів Конференції, у який входить:

- презентації (у форматі pdf),
- окремі повні відео \_усіх спікерів (у форматі mp4) - українською/російською мовою.

**Промо відео окремих виступів** можна подивитися по посиланням тут [укр/roc](#) (на YouTube),

**Вартість Комплекту** лише 5950 грн/EUR199. На наступних сторінках надано зміст матеріалів Конференції.

Для замовлення матеріалів, будь ласка, надішліть нам листа на e-mail: [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net).

**Контакти:** компанія Екстра Консалтинг, тел.:+38 (044) 227 81 73, , e-mail: [office@extra-consulting.net](mailto:office@extra-consulting.net)

### Партнери



## ЗМІСТ МАТЕРІАЛІВ КОНФЕРЕНЦІЇ

Назва презентації	Мова файлу презентації	Мова виступу на відео	Час виступу на відео (годин: хвилини)
<p><b>COVID-19 та фінансовий сектор: які результати та перспективи?</b></p> <p>Презентація: Півроку пандемії COVID-19: результати, уроки та прогнози для фінансового сектору</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Віталій Ваврищук, Директор Департаменту фінансової стабільності, НБУ</li> </ul> <p>Панельна дискусія:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Оляна Гордієнко, Голова Наглядової ради, Укрексімбанк (модератор)</li> <li>Віталій Ваврищук, Директор Департаменту фінансової стабільності, НБУ</li> <li>Юрій Блащук, Незалежний член Наглядової Ради, Укргазбанк</li> </ul>	UA	UA	1:22
<p><b>Вимоги НБУ до капіталу під ринкові ризики</b></p> <p>Презентація: Огляд вимог НБУ до капіталу під ринкові ризики.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Первін Дадашова, FRM, Начальник управління макропруденційної політики та досліджень, НБУ</li> </ul> <p>Панельна дискусія НБУ та банків – Обговорення нових регуляторних вимог до капіталу під ринкові ризики.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Первін Дадашова, FRM, Начальник управління макропруденційної політики та досліджень, НБУ (модератор)</li> <li>Назар Одинаєв, Директор Департаменту фінансових ризиків, Банк Креді Агриколь</li> <li>Ганна Рубльова, Директор Департаменту управління фінансовими ризиками, ОТП Банк</li> <li>Олексій Назаров, Начальник Управління ринкових ризиків та ризиків фінансових інститутів, Райффайзен Банк Аваль</li> <li>Юрій Табін, Заступник Директора Департаменту ринкового ризику та ризику ліквідності, Кредобанк</li> </ul>	UA	UA	1:37
<p><b>Деривативи: від оцінки до хеджування ринкових ризиків</b></p> <p>Презентація: Підходи НБУ до оцінки деривативів</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Надія Мешенко, FRM, Старший Фінансовий офіцер, Департамент Фінансів, IMF,</li> <li>Сергій Демиденко, в.о. Начальника управління фінансових та операційних ризиків, НБУ</li> </ul> <p>Сесія питань та відповідей по моделі оцінки та аукціонах НБУ з Процентного Свопу</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Надія Мешенко, FRM, Старший Фінансовий офіцер, Департамент Фінансів, IMF</li> <li>Сергій Демиденко, в.о. Начальника управління фінансових та операційних ризиків, НБУ</li> <li>Микола Селехман, FRM, CFA, Заступник Директора Департаменту відкритих ринків, НБУ, член Наглядової ради, Національний Депозитарій України</li> </ul>	UA	UA	0:57
<p>Панельна дискусія «Як, нарешті, запустити ринок валютних ф'ючерсів?»</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>Наскільки банки зацікавлені в валютних ф'ючерсах для власних цілей хеджування валютних ризиків?</li> <li>Наскільки клієнти банків - експортери та імпортери - зацікавлені в</li> </ol>	UA	UA/RU	1:48

<p>валютних ф'ючерсах? Або їх потреби в хеджуванні ризиків банки закривають форвардами? Чи розуміють клієнти відмінності між форвардами та ф'ючерсами?</p> <p>3. Для запуску ринку валютних ф'ючерсів потрібна не тільки торгова система, але також кліринговий та розрахунковий механізм з надійною системою управління ризиками, якому довірятиме НБУ, банки та їх великі експортери та імпортери. Які вимоги є у НБУ та банків до такого механізму клірингу та розрахунків? Який кліринг та розрахунки готові запропонувати біржі?</p> <p><b>Учасники дискусії:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Володимир Картавцев</b>, директор, <b>Екстра Консалтинг</b>, спів директор, <b>GARP Ukraine (модератор)</b></li> <li>• <b>Руслан Співак</b>, Директор Корпоративного бізнесу, <b>Райффайзен Банк Аваль</b></li> <li>• <b>Олексій Сухоруков</b>, Директор з розвитку бізнесу, <b>Українська біржа</b></li> <li>• <b>Олександр Дуда</b>, Начальник Центру ринків капіталу, <b>УкрСиббанк</b></li> <li>• <b>Антон Коваленко</b>, Директор департаменту Казначейства та фінансових інститутів, <b>ОТП Банк</b></li> <li>• <b>В'ячеслав Озеров</b>, Директор Департаменту Казначейства, <b>Банк Креді Агриколь</b></li> <li>• <b>Ткаченко Олег</b>, Голова Правління, <b>Банк «Розрахунковий Центр»</b></li> </ul>			
<p><b>Презентація: Досвід запуску валютних та інших деривативів у В'єтнамі</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Дмитро Колечко</b>, Член Правління, Головний Ризик Менеджер, <b>VP Bank (В'єтнамі)</b></li> </ul> <p>Ринок деривативів в Україні залишається на самому ранньому етапі. Але іноді не слід винаходити колесо заново. Досить поглянути на ринок деривативів, що розвивається, схожий на Україну, і зрозуміти причини його успіху. У своїй презентації Дмитро розповість, як був запуск ринку деривативів у В'єтнамі, що послужило головним поштовхом для його розвитку, розмір ринку та його форма, які похідні інструменти є найбільш популярними, що працює, а що ні.</p>	EN	RU	0:35
<p><b>Презентація: Товарні деривативи: уроки та перспективи для українського ринку</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Ярослав Невмержицький</b>, FRM, ERP, CFA, Головний Ризик Менеджер, <b>U.Commodities</b></li> </ul> <p>Товарні деривативи формують інтерес з боку комерційних банків з трьох основних причин:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>a) товарні деривативи є окремою і інвестиційно привабливою групою ринкових активів, які розширюють можливості для генерування прибутків, так і для диверсифікації власної експозиції до ризикових факторів в економіці;</li> <li>b) ринкові котирування біржових товарів (де факто товарних деривативів) використовуються як ринкові індикатори для макроекономічної аналітики та формування стрес-сценаріїв</li> <li>c) експозиція банку до ризиків товарних ринків формується і через можливий spill-over експозиції до товарних ринків клієнтів та контрагентів банку.</li> </ol> <p>У контексті згаданих вище тем у доповіді будуть розглянуті такі питання.</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Ціноутворення на товарних ринках: спільне та від'ємне у порівнянні з продуктами фінансового ринку.</li> <li>2. Фізичне vs фінансове виконання товарних деривативів</li> <li>3. Механізм впливу ринку деривативів на фізичний (спот) ринок: досвід та висновки для України.</li> </ol>	UA	UA	0:42