

X Щорічна Конференція Управління ринковими ризиками та ризиком ліквідності

market|risk|2021

12 жовтня 2021 | Офлайн + Онлайн
Версія від 23.09.21

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 (США)



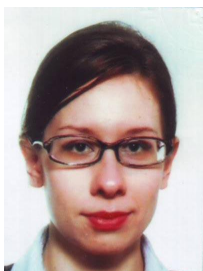
**Оксана
Волчко**
Член
Наглядової
ради
Укргазбанк



**Олександр
Роднянський**
Член
Наглядової
ради
Ощадбанк



**Віталій
Вавришчук**
Екс-Директор
департаменту
фінансової
стабільності
НБУ



Ганна Рубльова
CFA
Директор
Департаменту
управління
фінансовими
ризиками
ОТП Банк



**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
Райффайзен
Банк Аваль



Олег Ткаченко
Голова
Правління
Розрахунковий
Центр



Юрій Табін
Заступник
Директора
Департамен-
ту
ринкового
ризиків та
ризиків
ліквідності
Кредобанк



Ігор Олехов
Партнер
фінансової
практики
CMS Cameron
McKenna
Nabarro
Olswang

Партнери



ПРАВЕКС БАНК



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)**
- **Оксана Волчко**, Член Наглядової ради, **Укргазбанк**
- **Олександр Роднянський**, Член Наглядової ради, **Ощадбанк**
- **Віталій Ваврищук**, экс-Директор Департаменту фінансової стабільності, **НБУ (Україна)**
- **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**

Програма Конференції

0930-1000 Реєстрація учасників

1000-1010 Відкриття Конференції

Монетарна політика НБУ в умовах прискореної інфляції

1010-1040 Презентація: Монетарна політика НБУ: реакція на прискорення інфляції

- **Сергій Ніколайчук**, Заступник Голови, **НБУ**
- 1. Перспективи макроекономічного розвитку України та Монетарної політики 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.

1040-1140 Панельна дискусія з Макроекономіки та Монетарної політики НБУ:

- **Віталій Ваврищук**, екс-Директор Департаменту фінансової стабільності, **НБУ (модератор)**
- **Сергій Ніколайчук**, Заступник Голови, **НБУ**
- **Оксана Волчко**, Член Наглядової ради, **Укргазбанк**
- **Олександр Роднянський**, Член Наглядової ради, **Ощадбанк**

1140-1200 Перерва на каву

Вимоги НБУ до капіталу під ринкові ризики

1200-1230 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.

1230-1330 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**

1330-1410 Перерва на ланч

Інновації у управлінні ринковими ризиками

1410-1450 **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.

1450-1530 **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.

1530-1600 **Перерва на каву**

1600-1640 **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-IX
2. Валютні обмеження, Ліквідаційний неттінг, Остаточність розрахунків
3. Документування для деривативів

1640-1720 **Презентація: Ринок Репо 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 Репо, 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.

1720-1800 **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.

1800 **Закриття Конференції**

1810-1930 **Фуршет**

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. 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. 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.

Якщо у Вас є питання, будь ласка, напишіть нам на email 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

сайт: www.extra-consulting.net

Про організатора

20 YEARS EXTRA consulting

Екстра Консалтинг (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 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?
ПІБ Посада Моб телефон e-mail Член UUPN Член GARP	<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
ПІБ Посада Моб телефон e-mail Член UUPN Член GARP	<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.

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

Детальна інформація на сайті www.extra-consulting.net або за тел. +380 99 741 95 73