

## ***Jeseň s reguláciou***

Semináre pre banky organizované skúsenými profesionálmi z PwC.

### ***Bratislava***



***12. 11. IRRBB - Úrokové riziko bankovej knihy***

***13. 11. CRD IV/CRR - aktuálne znenie a pripravované zmeny***

***14. 11. Basel IV***

Semináre sa konajú vždy od 9:00 do 17:00 v priestoroch PwC Bratislava



***1 osoba***

290 EUR/os

740 EUR/os

***Cenník***  
*(bez DPH)*

***Počet kurzov***

1 kurz

3 kurzy



***2 a viac osôb***

270 EUR/os

640 EUR/os

***(Uzávierka prihlášok je 14 dní pred konaním danej akcie)***

***Vašou lektorkou bude skúsená expertka s dlhoročnou praxou v oblasti bankovej regulácie a riadenia rizík Silvia Majlingová.***



Silvia pôsobí v PwC od roku 2017. Má viac ako 20 rokov skúseností v oblasti riadenia rizík a regulácie finančných inštitúcií. V minulosti pracovala pre Českú sporiteľňu, Komerčnú banku a ČSOB na pozíciách v internom audite, riadení rizík, ALM a Treasury.



12. 11. 2018



Karadžičova 2/A, Bratislava



+420 251 152 020



tereza.subrtova@pwc.com  
[www.pwc.cz/regulace](http://www.pwc.cz/regulace)

Seminár je určený pre risk manažérov, interných audítorov, pracovníkov ALM/Treasury a všetkých zamestnancov, ktorí si potrebujú rozšíriť vedomosti v oblasti riadenia úrokového rizika

## Seminár má za cieľ poskytnúť prehľadnú informáciu o

- základných regulačných požiadavkách na riadenie úrokového rizika bankovej knihy (IRRBB)
- aktualizovaných Usmerneniach EBA, ktoré vstupujú do platnosti 30. 6. 2019 – **EBA Guidelines on the management of interest rate risk arising from non-trading book activities - EBA/GL/2018/02**
- kritériách posúdenia úrokového rizika bankovej knihy zo strany orgánov dohľadu - **Guidelines for common procedures and methodologies for the supervisory review and evaluation process (SREP) EBA/GL/2018/03**
- štandarde Bazilejského výboru (BCBS) - **Interest rate risk in the banking book**
- požiadavkách na zahrnutie úrokového rizika bankovej knihy do 2. piliera (ICAAP)

## Program seminára

- **Prehľad základnej legislatívy**
- **Banking Book vs. Trading Book**
- **Požiadavky na IRRBB (EBA/GL/2018/02)**
  - Identifikácia, kalkulácia a alokácia kapitálu pre ICAAP (Pilier 2)
  - Governance
  - Meranie úrokového rizika bankovej knihy – predpoklady a metódy (statické a dynamické), Economic Value of Equity (EVE) vs. Earnings at Risk (EaR), scenáre úrokových šokov, behaviorálne predpoklady
  - Regulatory outlier test
- **Posúdenie úrokového rizika bankovej knihy regulátorom (EBA/GL/2018/03,**
  - Stratégia a rizikový apetít
  - Analýza scenárov a stresového testovania
  - Identifikácia, meranie, monitorovanie a reporting
  - Kontrolné mechanizmy, systém limitov
  - Kritéria pre hodnotenie (bodovanie)
- **Interest rate risk in the banking book – BCBS Standard (April 2016)**

# CRD IV/ CRR



13. 11. 2018



Karadžičova 2/A, Bratislava



+420 251 152 020



tereza.subrtova@pwc.com  
[www.pwc.cz/regulace](http://www.pwc.cz/regulace)

*Seminár je určený pre risk manažérov, interných audítorov a všetkých zamestnancov, ktorí si potrebujú rozšíriť vedomosti z problematiky CRD IV/CRR.*

## ***Seminár má za cieľ poskytnúť prehľadnú informáciu o***

- základných požiadavkách CRD IV/CRR prijatých
  - Smernicou EP a Rady (EÚ) 2013/36/EÚ z 26. 6. 2013 o prístupe k činnosti úverových inštitúcií a obozretnom dohľade nad úverovými inštitúciami a investičnými spoločnosťami,
  - Nariadením EP a Rady (EÚ) č. 575/2013 z 26. 6. 2013 o obozretných požiadavkách pre úverové inštitúcie a investičné spoločnosti ktorými sa implementujú pravidlá BASEL III v rámci EÚ
- transpozícii smernice CRD IV do legislatívy SR (novela zákona o bankách)
- návrhoch Európskej komisie na doplnenie legislatívy z roku 2013 (ukazovateľ finančnej páky, pomer čistého stabilného financovania / NSFR, veľké majetkové angažovanosti, trhové riziko, Pilier 2)

## ***Program seminára***

- **Požiadavky na kapitál** (Solvency ratio, Leverage ratio, Capital buffers)
- **Požiadavky na likviditu** (LCR, NSFR, monitorovacie nástroje)
- **Internal governance** (odmeňovanie, transparentnosť)
- **Implementácia CRD IV/CRR**
- **Návrhy CRD V/CRR II**

# Basel IV



14. 11. 2018



Karadžičova 2/A, Bratislava



+420 251 152 020



tereza.subrtova@pwc.com  
[www.pwc.cz/regulace](http://www.pwc.cz/regulace)

Seminár je určený pre risk manažérov, interných audítorov a všetkých zamestnancov, ktorí si potrebujú rozšíriť vedomosti z problematiky Basel IV.

Seminár **nadväzuje na tematiku CRD IV/CRR** a má za cieľ poskytnúť prehľadnú informáciu o **aktualizovaných pravidlách Bazilejského výboru** pre bankový dohľad (tzv. Basel IV), ktoré vstupujú do platnosti od 1. 1. 2022

## Program seminára

- **Minimum capital requirements for market risk**– Standard (January 2016)
- **Interest rate risk in the banking book** - Standard ( April 2016)
- **Basel III: Finalizing post-crisis reform (December 2017):**
  - Standardised approach for credit risk
  - IRB approach for credit risk
  - Minimum capital requirements for CVA risk
  - Minimum capital requirements for operational risk
  - Output floor
  - Leverage ratio
- **Revisions to the minimum capital requirements for market risk** (March 2018)