

Podzim s regulací

Semináře pro banky organizované
zkušenými profesionály z PwC

Praha



19. 11. - IRRBB – Úrokové riziko bankovní knihy

20. 11. - CRD IV/CRR - aktuální znění a připravované změny

21. 11. - Basel IV

Semináře se konají vždy od 9:00 do 17:00 v prostorech PwC Praha.



1 osoba

Ceník
(bez DPH)

Počet kurzů



2 a více osob

7 500 Kč/os

1 kurz

6 900 Kč/os

19 000 Kč/os

3 kurzy

16 500 Kč/os

Uzávěrka přihlášek je 14 dní před konáním dané akce.

Vaší lektorkou bude zkušená expertka s mnohaletou praxí v oblasti bankovní regulace a řízení rizik Silvia Majlingová.



Silvia působí v PwC od roku 2017. Má více než 20 let zkušeností v oblasti řízení rizik a regulací finančních institucí. V minulosti pracovala pro Českou spořitelnu, Komerční banku a ČSOB na pozicích v interním auditu, řízení rizik, ALM a Treasury.



19. 11. 2018



Hvězdova 1734/2c, Praha



+420 251 152 020



tereza.subrtova@pwc.com
www.pwc.cz/regulace

Seminář je určený risk manažerům, interním auditorům, pracovníkům ALM/Treasury i všem zaměstnancům, kteří si potřebují rozšířit vědomosti v oblasti řízení úrokového rizika.

Seminář má za cíl poskytnout přehledné informace o

- základních regulatorních požadavcích na řízení úrokového rizika bankovní knihy (IRRBB)
- aktualizovaných Obecných pokynech EBA, které vstupují v platnost dne 30. 6. 2019 – **EBA Guidelines on the management of interest rate risk arising from non-trading book activities - EBA/GL/2018/02**
- kritériích posouzení úrokového rizika bankovní knihy ze strany orgánů dohledu - **Guidelines for common procedures and methodologies for the supervisory review and evaluation process (SREP) EBA/GL/2018/03**
- standardu Basilejského výboru (BCBS) – **Interest rate risk in the banking book**
- požadavcích na zahrnutí úrokového rizika bankovní knihy do 2. pilíře (ICAAP)

Program semináře

- **Přehled základní legislativy**
- **Banking Book vs. Trading Book**
- **Požadavky na IRRBB (EBA/GL/2018/02)**
 - Identifikace, kalkulace a alokace kapitálu pro ICAAP (2. pilíř)
 - Governance
 - Měření úrokového rizika bankovní knihy – předpoklady a metody (statické a dynamické), Economic Value of Equity (EVE) vs. Earnings at Risk (EaR), scénáře úrokových šoků, behaviorální předpoklady
 - Regulatory outlier test
- **Posouzení úrokového rizika bankovní knihy regulátorem (EBA/GL/2018/03)**
 - Strategie a rizikový apetit
 - Analýza scénářů a stresového testování
 - Identifikace, měření, monitorování a reporting
 - Kontrolní mechanismy, systém limitů
 - Kritéria pro hodnocení (bodování)
- **Interest rate risk in the banking book – BCBS Standard (April 2016)**

CRD IV/ CRR



20. 11. 2018



Hvězdova 1734/2c, Praha



+420 251 152 020



tereza.subrtova@pwc.com
www.pwc.cz/regulace

Seminář je určený risk manažerům, interním auditorům i všem zaměstnancům, kteří si potřebují rozšířit vědomosti v problematice CRD IV/CRR.

Seminář má za cíl poskytnout přehledné informace o

- základních požadavcích CRD IV/CRR přijatých
 - Směrnicí EP a Rady (EU) 2013/36/EU z 26. 6. 2013 o přístupu k činnosti úvěrových institucí a obezřetném dohledu nad úvěrovými institucemi a investičními společnostmi,
 - Nařízením EP a Rady (EU) č. 575/2013 z 26. 6. 2013 o obezřetnostních požadavcích pro úvěrové instituce a investiční společnostikterými se implementují pravidla BASEL III v rámci EU
- návrzích Evropské komise na doplnění legislativy z roku 2013 (ukazatel finanční páky, poměr čistého stabilního financování / NSFR, velké expozice, tržní riziko, Pilíř 2)

Program semináře

- **Požadavky na kapitál** (Solvency ratio, Leverage ratio, Capital buffers)
- **Požadavky na likviditu** (LCR, NSFR, monitorovací nástroje)
- **Internal governance** (odměňování, transparentnost)
- **Implementace CRD IV/CRR**
- **Návrhy CRD V/CRR II**

Basel IV



21. 11. 2018



Hvězdova 1734/2c, Praha



+420 251 152 020



tereza.subrtova@pwc.com
www.pwc.cz/regulace

Seminář je určený risk manažerům, interním auditorům i všem zaměstnancům, kteří si potřebují rozšířit vědomosti o problematice Basel IV.

Seminář navazuje na tematiku CRD IV/CRR a má za cíl poskytnout přehledné informace o aktualizovaných pravidlech Basilejského výboru pro bankovní dohled (tzv. Basel IV), které vstupují v platnost dne 1. 1. 2022

Program semináře

- **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)