

**Data: 31 lipca 2019 roku (środa)**

Miejsce: Centrum Konferencyjno-Szkoleniowe UOKiK (vis-a-vis hotelu Gromada),  
pl. Powstańców Warszawy 1, Warszawa

Organizator: Urząd Komisji Nadzoru Finansowego

### **Cel**

---

Celem seminarium jest omówienie obowiązujących i aktualnie wdrażanych regulacji oraz metod pomiaru ryzyka płynności i ryzyka stopy procentowej w księdze bankowej mających zastosowanie w banku spółdzielczym.

### **Kto powinien wziąć udział?**

---

Seminarium skierowane jest do pracowników banków spółdzielczych odpowiedzialnych za pomiar i monitorowanie ryzyka płynności oraz ryzyka stopy procentowej w księdze bankowej.

### **Forma**

---

Seminarium będzie miało formę prezentacji połączonej z dyskusją.

### **Harmonogram czasowy**

---

Rejestracja uczestników na seminarium rozpocznie się od godziny **9.30**

Rozpoczęcie seminarium o godzinie **10.00**

Seminarium zakończy się o godzinie **16.00**

### **Zgłoszenia: liczba miejsc ograniczona**

---

Zgłoszenia będą przyjmowane wyłącznie za pośrednictwem elektronicznego formularza zgłoszeniowego dostępnego pod adresem [www.knf.gov.pl](http://www.knf.gov.pl) w dziale „CEDUR” aż do wyczerpania miejsc. Potwierdzenia uczestnictwa zostaną przesłane najpóźniej w dniu **26 lipca 2019 r.**

Kontakt:

**Aleksandra Leśniak, tel. 22 262 53 28**

**Paweł Panicz, tel. 22 262 56 83**

**cedur@knf.gov.pl**

### **Oplaty**

---

Udział w seminarium jest bezpłatny. Uczestnicy otrzymają materiały konferencyjne.

## PROGRAM

31 lipca 2019 r. (środa)

Centrum Konferencyjno-Szkoleniowe UOKiK (vis-a-vis hotelu Gromada),  
pl. Powstańców Warszawy 1, Warszawa

*Prelegent: Anna Kuligowska*

*Ekspert*

*Departament Rozwoju Regulacji*

*Urząd Komisji Nadzoru Finansowego*

Godzina	Temat
9:30-10:00	Rejestracja uczestników i bufet kawowy
10:00-12:00	Zarządzanie ryzykiem płynności – główne regulacje krajowe i międzynarodowe <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ Rekomendacja P</li> <li>▪ Uchwała KNF 386/2008</li> <li>▪ Rozporządzenie MRiF z 6 marca 2017 r.</li> <li>▪ Standardy BCBS</li> <li>▪ CRD IV/CRR wraz z RTS i ITS</li> <li>▪ Akt Delegowany EU 2015/61 z nowelizacją</li> <li>▪ CRD V/CRR II</li> </ul>
12:00-12:30	Przerwa na kawę
12:30-13:30	Zarządzanie ryzykiem płynności w praktyce <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ Podział kompetencji vs horyzont pomiaru</li> <li>▪ Metody pomiaru, m.in. luka płynności, stabilność bazy depozytowej, wskaźniki wewnętrzne</li> </ul>
13:30-13:45	Przerwa na kawę

<b>13:45-15:45</b>	<b>Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w księdze bankowej</b> <ul style="list-style-type: none"><li>▪ <b>Główne regulacje krajowe i międzynarodowe</b><ul style="list-style-type: none"><li>▪ <b>Rekomendacja G</b></li><li>▪ <b>Rozporządzenie MRiF z 6 marca 2017 r.</b></li><li>▪ <b>Standardy BCBS</b></li><li>▪ <b>Wytoczne EBA</b></li></ul></li><li>▪ <b>Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w księdze bankowej w praktyce</b><ul style="list-style-type: none"><li>▪ <b>Instrumenty finansowe generujące ryzyko stopy procentowej</b></li><li>▪ <b>Metody pomiaru, m.in. luka przeszacowania, BPV, VaR, miary ryzyka bazowego i opcji klienta, inne miary</b></li></ul></li></ul>
<b>15:45-16:00</b>	<b>Pytania i dyskusja</b>