

Data: 2 grudnia 2020 roku (środa)

Forma seminarium: webinarium

Organizator: Urząd Komisji Nadzoru Finansowego

Cel

Celem seminarium jest zapoznanie przedstawicieli banków komercyjnych z najnowszymi wydarzeniami oraz wyzwaniami związanymi z trwającą reformą wskaźników referencyjnych typu IBOR.

Kto powinien wziąć udział?

Seminarium skierowane jest do banków komercyjnych.

Forma

Seminarium odbędzie się w formie webinarium.

Harmonogram czasowy

Logowanie uczestników na seminarium rozpocznie się od godziny **9:45**

Rozpoczęcie seminarium o godzinie **10:00**

Seminarium zakończy się o godzinie **14:00**

Zgłoszenia

Zgłoszenia będą przyjmowane wyłącznie za pośrednictwem elektronicznego formularza zgłoszeniowego dostępnego pod adresem www.knf.gov.pl w dziale „CEDUR”. Potwierdzenia uczestnictwa zostaną przesłane najpóźniej w dniu **27 listopada 2020 roku**.

Informacje techniczne

W celu uczestnictwa w spotkaniu niezbędne jest stabilne łącze internetowe. W spotkaniu uczestniczyć można poprzez przeglądarkę internetową lub aplikację. Szczegółowe informacje techniczne zostaną przesłane wraz z potwierdzeniami uczestnictwa.

Opłaty

Udział w seminarium jest bezpłatny.

Kontakt

Wszelkie pytania dotyczące organizacji seminarium należy kierować na adres cedur@knf.gov.pl w tytule podając tytuł i datę seminarium.

PROGRAM**2 grudnia 2020 roku (środa)***Prelegent: Michał Kruszka – Dyrektor**Michał Kamiński – Starszy Specjalista**Departament Analiz i Strategii**Urząd Komisji Nadzoru Finansowego*

Godzina	Temat
9:45-10:00	Logowanie uczestników
10:00-11:15	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Przyczyny objęcia szczególnym nadzorem wskaźników referencyjnych typu IBOR <ul style="list-style-type: none"> ▪ Manipulacje wskaźnikami LIBOR i EURIBOR ▪ Reakcja regulatorów – Raport Wheatleya, wytyczne IOSCO, stanowisko FSB ▪ uchwalenie BMR ▪ Przyszłość kluczowych wskaźników referencyjnych typu IBOR <ul style="list-style-type: none"> ▪ Dostosowanie LIBOR i EURIBOR do wymogów BMR ▪ Stanowisko FCA dotyczące przyszłości wskaźnika LIBOR ▪ Poszukiwanie alternatyw – główne kierunki <ul style="list-style-type: none"> ▪ Główne rekomendacje grup roboczych poszukujących alternatywnych wskaźników referencyjnych w strefie Euro, Stanach Zjednoczonych, Wielkiej Brytanii oraz Szwajcarii ▪ Przykład reformy wskaźnika referencyjnego Eonia <p><i>Michał Kamiński – Starszy Specjalista Departament Analiz i Strategii Urząd Komisji Nadzoru Finansowego</i></p>
11:15-11:30	Przerwa
	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Główne cechy alternatywnych wskaźników referencyjnych wolnych od ryzyka <ul style="list-style-type: none"> ▪ Przykłady metod opracowywania wskaźników ESTR, SONIA, SOFR oraz SARON ▪ Skala zastosowania wskaźników alternatywnych na rynkach finansowych ▪ W jaki sposób można zbudować strukturę terminową dla wskaźników typu overnight

<p>11:30-13:00</p>	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Raport FSB dotyczący zaawansowania reformy wskaźników referencyjnych (stan lipiec 2020 r.) <ul style="list-style-type: none"> ▪ Podsumowanie głównych osiągnięć trwającej reformy i główne wyzwania na 2021 ▪ Wskazanie głównych obszarów wymagających intensyfikacji prac ▪ Wyzwania związane z tzw. „legacy portfolio”, czyli aktywami z ery przed BMR <ul style="list-style-type: none"> ▪ Możliwość zastosowania wynikających z BMR planów awaryjnych wobec umów sprzed 2018 r. ▪ Propozycja legislacyjna Komisji Europejskiej dotycząca wprowadzenia instytucji „zastępczego wskaźnika referencyjnego” ▪ Polski sektor finansowy – główne wyzwania związane z reformą wskaźników referencyjnych <ul style="list-style-type: none"> ▪ Poszukiwanie optymalnego wskaźnika/wskaźników alternatywnych dla WIBOR ▪ Wyzwania związane z niepewną przyszłością wskaźnika LIBOR CHF – w tym stanowisko szwajcarskiej National Working Group wobec tzw. syntetycznego LIBOR CHF <p><i>Michał Kruszka – Dyrektor Departament Analiz i Strategii Urząd Komisji Nadzoru Finansowego</i></p>
<p>13:15-13:30</p>	<p>Przerwa</p>
<p>13:30-14:00</p>	<p>Sesja Q&A</p>