

FUNDAMENTAL REVIEW OF TRADING BOOK

5. června 2019

Business Park Košiče, Jinonická 80, Praha 5

Seminář je určen *analytikům a manažerům tržního rizika, interním auditorům a pracovníkům compliance.*



Seminář vede odborník v oblasti finančního rizika

Mgr. Ing. Václav Novotný

Václav Novotný je ředitelem a majitelem společnosti Advanced Risk Management, s.r.o. Již 20 let se specializuje na poradenství a školení v oblasti identifikace, měření a řízení finančních rizik. V roce 1994 započal svou kariéru v investičním oddělení České pojišťovny, a.s. Václav Novotný je zakládajícím členem a předsedou sdružení Risk Management Klub a je často zvaným lektorem na konferencích a seminářích uznávaných institucí. Václav Novotný vystudoval Matematicko-fyzikální fakultu Univerzity Karlovy a Fakultu financí a účetnictví Vysoké školy ekonomické v Praze.

PROGRAM SEMINÁŘE

ÚVOD, ANEB NEŽ SE DO TOHO PUSTÍME

- Definice tržního rizika
- Pojem bankovní x obchodní kniha
- Shrnutí metod používaných pro měření tržního rizika
- Shrnutí aktuálně platných přístupů pro výpočet kapitálového požadavku k tržnímu riziku
- Regulační proces (BCBS, EU, EBA, ČNB)

FUNDAMENTAL REVIEW OF TRADING BOOK DLE BCBS – SHRUTÍ KONCEPTU

- Motivace a shrnutí hlavních změn
- Hranice mezi obchodní knihou a bankovní knihou
- Používané přístupy
- Harmonogram implementace FRTB dle BCBS

NOVÝ STANDARDIZOVANÝ PŘÍSTUP K TRŽNÍMU RIZIKU

- Struktura standardizovaného přístupu
- Sensitivities-based Method
- Default Risk Charge
- Residual Risk Add-On

ZJEDNODUŠENÝ STANDARDIZOVANÝ PŘÍSTUP

- Motivace
- Struktura zjednodušeného standardizovaného přístupu
- Podmínky použití

INTERNÍ MODEL K TRŽNÍMU RIZIKU

- Podstata interního modelu
- Výpočet Expected Shortfall
- Výpočet kapitálového požadavku
- Kvalitativní požadavky

IMPLEMENTACE FRTB V RÁMCI EU

- Předpokládaná legislativní cesta
- Možné odchylky vůči standardu BCBS
- Předpokládaný harmonogram implementace
- Odhadovaný dopad na banky v EU

SHRUTÍ SEMINÁŘE A ZÁVĚR

Průběh semináře: Seminář se koná od 9.00 do 17.00 (s přestávkami v 10.30, 12.30 a 15.15). Po skončení semináře následuje koktejl, na kterém je možné dále diskutovat.

FUNDAMENTAL REVIEW OF TRADING BOOK

REFERENCE

Agropol Trading, s.r.o.
Air Bank a.s.
Artesa, spořitelní družstvo
Aviva životní pojišťovna, a.s.
CENTRAL EUROPEAN ADVISORY GROUP
Citibank Europe plc, organizační složka
Čepro, a.s.
ČEPS, a.s.
Česká exportní banka, a.s.
Česká národní banka
Česká podnikatelská pojišťovna, a.s.
Česká pojišťovna, a.s.
Česká spořitelna, a.s.
Česká spořitelna – penzijní společnost, a.s.
Českomoravská hypoteční banka, a.s.
Českomoravská stavební spořitelna, a.s.
Českomoravská záruční a rozvojová banka, a.s.
Československá obchodní banka, a.s.
ČEZ, a.s.
ČSOB Pojišťovna, a.s.
Equa bank a.s.
Exportní garanční a pojišťovací společnost, a.s.

Generali Pojišťovna a.s.
Hypoteční banka, a.s.
Komerční banka, a.s.
Kooperativa pojišťovna, a.s.
KPMG Česká republika, s.r.o.
ING Bank N.V.
ING Životní pojišťovna N.V.,
pobočka pro Českou republiku
Investiční kapitálová společnost KB, a.s.
J&T Banka, a.s.
KB Penzijní společnost, a.s.
Moneta Money Bank, a.s.
Moravský Peněžní Ústav – spořitelní družstvo
Moravia IT, a.s.
Národní banka Slovenska
NESS Czech s.r.o.
NET4GAS, s.r.o.
Nova KBM d.d.
OTP Banka Slovensko, a.s.
Penzijní fond České pojišťovny, a.s.
Pojišťovna České spořitelny, a.s.
Poštová banka, a.s.

PPF banka a.s.
Pražská energetika, a.s.
Prima banka Slovensko, a.s.
Raiffeisen stavební spořitelna a.s.
Raiffeisenbank a.s.
s Autoleasing, a.s.
Sberbank CZ, a.s.
Scania Finance Czech Republic, spol. s r.o.
Slovenská banková asociácia
Slovenská sporiteľňa, a.s.
Slovenský plynárenský priemysel, a.s.
Slovnaft, a.s.
STABILITA, d.d.s., a.s.
ŠkoFIN, s.r.o.
Telefónica O2 Czech Republic, a.s.
Triglav pojišťovna, a.s.
UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.
Unipetrol, a.s.
Všeobecná úverová banka, a.s.
Zentiva, a.s.
Železničná spoločnosť Slovensko, a.s.

Věříme, že naše semináře budou, stejně jako minulým účastníkům, užitečné i vám.

ORGANIZAČNÍ INFORMACE K SEMINÁŘI

Přihlášení: Na seminář se můžete přihlásit na našich webových stránkách www.arm.cz/prihlaska nebo e-mailem na adresu arm@arm.cz. Přijetí přihlášky vám potvrdíme zasláním e-mailu.

Poplatek: Účastnický poplatek za seminář „FRTB – Fundamental Review of Trading Book“ činí 9 900 Kč + DPH. Poplatek za seminář zahrnuje kurzovní, studijní materiály, kompletní celodenní občerstvení včetně obědů.

Po přihlášení bude vystavena zálohová faktura. Platba (provedena před termínem konání akce) je zálohou ve výši 100 % sjednaného poplatku. Daňový doklad obdrží účastník po zaplacení zálohové faktury nebo po skončení semináře poštou. Platby poukazujete na účet společnosti Advanced Risk Management, s.r.o. číslo 13923349/0800 vedený u České spořitelny, a.s. na základě zaslání zálohové faktury.

Storno podmínky: Účast na semináři lze zrušit pouze písemně. V případě odhlášení nejpozději 3 týdny před zahájením akce bude účtován stornovací poplatek ve výši 10 % z uhrazené ceny. Při zrušení objednávky v době kratší než 3 týdny před zahájením akce je splatný celý účastnický poplatek bez náhrady. Organizace může vyslat na tento seminář jiného účastníka, než který byl původně přihlášen.

Advanced Risk Management, s.r.o. si vyhrazuje právo zrušit pořádání semináře a vrátit účastníkům zpět celou uhrazenou zálohu. Přihlašující organizace i účastník berou na vědomí, že svým přihlášením akceptují všechny výše uvedené podmínky.

Ochrana osobních údajů: Advanced Risk Management, s.r.o. primárně pracuje s údaji, které jsou poskytnuty v rámci objednávky služeb. Jedná se zejména o následující údaje: E-mail; a Jméno

a Příjmení (případně akademický titul); a Kontaktní (doručovací a/nebo fakturační adresu); a Telefonní číslo; a Pracovní pozice.

Přehled základních zásad a principů ochrany osobních údajů a dalších údajů zpracovaných společností Advanced Risk Management, s.r.o. naleznete na webové stránce společnosti www.arm.cz (Informace a přístup k osobním údajům).

Ostatní ujednání Advanced Risk Management, s.r.o. informuje účastníky, že na seminářích či jiných akcích pořizuje fotografie, které účastníky zachycují při účasti na seminářích a akcích. Společností Advanced Risk Management, s.r.o. tyto fotografie poskytuje pouze ostatním účastníkům stejné akce, neposkytuje je třetím osobám a ani je nezveřejňuje. Účastníci mohou požádat, aby focení nebyli nebo aby jejich fotografie byly smazány a Advanced Risk Management, s.r.o. musí jejich požadavek dodržet.

PŘIHLÁŠKA NA SEMINÁŘ FRTB – FUNDAMENTAL REVIEW OF TRADING BOOK

Seminář
FRTB – Fundamental Review
of Trading Book
5. června 2019

Jméno, příjmení a titul účastníka _____

Funkce _____

Firma _____

Adresa _____

Tel. _____ Fax _____

IČO _____

DIČ _____

e-mail _____

Přihlašující organizace potvrzuje, že závazně přihlašuje účastníka na tento seminář.

_____ podpis a razítko organizace

_____ podpis účastníka

Chcete-li se během semináře zaměřit na vybrané téma nebo řešit v rámci případových studií konkrétní problém, napište nám prosím svůj návrh.

Advanced Risk Management, s.r.o.

Paříkova 3
190 00 Praha 9
t +420-257 290 252
f +420-257 290 473
e arm@arm.cz
i www.arm.cz

IČO 26140403 • DIČ CZ26140403 • Městský soud v Praze, oddíl C, vložka 73787

