

OFERTA SZKOLENIOWA

➤ **TEMAT SZKOLENIA:** Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w Banku z uwzględnieniem wytycznych EBA i SOZ BPS.

➤ **TERMIN:** 8-9 maja 2023 r.

➤ **PROWADZĄCY:**

Robert Konieczny - 18-letnie doświadczenie w bankowości w sektorze banków spółdzielczych, spółdzielczych kas oszczędnościowo – kredytowych oraz banków komercyjnych na stanowiskach specjalistycznych, menadżerskich i zarządczych. Praktyk w obszarze zarządzania ryzykiem bankowym. Wieloletni wykładowca w Wyższej Szkole Bankowej we Wrocławiu oraz SGGW w Warszawie.

➤ **HARMONOGRAM SZKOLENIA**

Szkolenie przygotowano jako dwa x jednodniowe spotkania, gdzie:

- a) pierwsza część poświęcona będzie przedstawieniu teorii z zakresu zarządzania stopą procentową natomiast,
- b) druga część to praktyczne warsztaty z wykorzystaniem arkusza Excel, na których uzyskaną wcześniej wiedzę będzie można wykorzystać na konkretnych przykładach.

Cel szkolenie:

Szkolenie wraz z warsztatami przybliży i usystematyzuje wiedzę z zakresu zarządzania ryzykiem stopy procentowej. Ryzyko stopy procentowej jest nierozzerwalnie związane z prowadzeniem działalności na rynku bankowym. Banki zarabiają na ponoszeniu tego ryzyka jednak jego materializacja może zachwiać każdą instytucją.

W trakcie szkolenia uczestnicy nauczą się identyfikować poszczególne komponenty ryzyka stopy procentowej oraz prawidłowo je oceniać. Poznają podstawowe metody pomiaru ryzyka stopy procentowej oraz nauczą się je stosować, umiejętnie wykorzystując ich wady i zalety tak, aby zbudować efektywny i spójny model pomiaru ryzyka.

Zakres szkolenie skoncentrowany jest na identyfikacji i pomiarze źródeł ryzyka stopy procentowej, w szczególności ryzyka bazowego, opcji klienta, krzywej dochodowości i przeszacowania, wskazując najlepsze praktyki rynkowe w tym zakresie oraz przekazując praktyczne wskazówki umożliwiające zastosowanie zdobytej wiedzy w codziennej pracy.

Tematyka:

1. Wprowadzenie do ryzyka stopy procentowej
 2. Identyfikowanie ryzyka stopy procentowej:
 - a. Ryzyko przeszacowania,
 - b. Ryzyko bazowe,
 - c. Ryzyko krzywej dochodowości,
 - d. Ryzyko opcji klienta.
 3. Pomiar ryzyka stopy procentowej:
 - a. Analiza luki przeszacowania,
 - b. Symulacja zmian wyniku odsetkowego.
 4. Limitowanie i monitorowanie ryzyka stopy procentowej
 5. Testy warunków skrajnych dla ryzyka stopy procentowej
 - a. Założenie zapewniające prawidłowe przeprowadzanie testów warunków skrajnych,
 - b. Analiza testów warunków skrajnych.
 6. Wytyczne EBA w zakresie zarządzania ryzykiem stopy procentowej w portfolio bankowym.
- **FORMA I CZAS TRWANIA SZKOLENIA:** 9.30-13.30 .
Szkolenie odbywa się w formie on-line.
- **CENA SZKOLENIA:**
600 zł+ VAT- Banki Spółdzielcze Zrzeszone w ZRBS;
650 zł+ VAT- Banki Spółdzielcze niezrzeszone.
- **ZGŁOSZENIA:**<https://zrbs.pl/zarzadzanie-ryzykiem-stopy-procentowej-w-banku-z-uwzglednieniem-wytycznych-eba-i-soz-bps/>