



Seminar: Upravljanje rizikom likvidnosti i kamatnim rizikom u bankarskoj knjizi

 18 - 19. septembar

 Udruženje banaka Srbije, V sprat

Cena za članice UBS - poslovne banke: 15.000,00 RSD (PDV uračunat)
Kotizacija za događaj: 20.000,00 RSD (PDV uračunat)

18.09.2024.

**Kontrola i upravljanje
rizikom likvidnosti i
kamatnim rizikom u
knjizi banke**

A. Rizik likvidnosti

1. Terminološki uvod - od upravljanja likvidnošću do upravljanja rizikom
2. Opšte o riziku
3. Evolucija regulatornog koncepta likvidnosne adekvatnosti
4. Mere rizika likvidnosti

B. Kamatni rizik

1. Priča o dve knjige: Specifikacija TB / BB delineacije
2. Koncepti duracije i konveksnosti
3. Kamatni jaz u osetljivosti, efektivna godišnja kamatna stopa (EAR) i ekonomska vrednost kapitala (EVE)
4. Regulatorni tretman

19.09.2024.

**Proces procene
adekvatnosti interne
likvidnosti – ILAAP**

1. Svrha uspostavljenih smernica za ILAAP - EBA smernice vs. lokalni regulatorni propisi

2. Sveobuhvatnost i proporcionalnost ILAAP prirode i obima poslovnih aktivnosti banke

3. Osnovni principi ILAAP-a

4. Uloga i mesto ILAAP-a u sastavu celokupnog upravljanja u banci

5. Doprinos kontinuitetu poslovanja banke osiguravanjem likvidnosne adekvatnosti

6. Identifikacija i tretman materijalnih rizika u ILAAP-u

7. Nužnost visokog kvaliteta

8. Prikladnost, doslednost u primeni i nezavisna validacija ILAAP-a

9. Redovno testiranje

Predavač: **Stjepan Anić** je dugogodišnji predavač i konsultant iz područja **upravljanja i kvantitativnog modeliranja finansijskih rizika** u Hrvatskoj i inostranstvu. Bavi se problematikom kontrole i upravljanja rizicima u finansijskim institucijama.