



STOWARZYSZENIE RYNKÓW  
FINANSOWYCH  
ACI POLSKA

Afiliowane przy ACI - The Financial  
Markets Association

kdpw\_

Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych

Partner Szkolenia

Warszawa, 4 kwiecień 2012

Szanowni Państwo,

Z przyjemnością informujemy, że szkolenie Advanced ALM prowadzone przez firmę Finance Trainer odbędzie się w dniach 14-16 maja 2012 r. Podczas tego szkolenia korzystamy z gościnności KDPW S.A w Warszawie, który jako Partner Szkolenia użycza nam sali w budynku Centrum Giełdowe, przy ulicy Książęcej 4, VI p..

Całkowity koszt szkolenia wynosi **3700 PLN + VAT**.

Cena zawiera koszt szkolenia, dostęp do materiałów CyberSchool od 14 kwietnia br , całodzienny serwis kawowy oraz lunch.

Członkom Stowarzyszenia przysługuje upust w kwocie **1000 PLN** od kwoty brutto.

**Prosimy składanie imienny deklaracji uczestnictwa w szkoleniu na adres [aci@acipolska.pl](mailto:aci@acipolska.pl). Z uwagi na długą listę oczekujących zgłoszenie powinno wpłynąć do dnia 12 kwietnia 2012 roku.** W przypadku braku potwierdzenia, miejsce zostanie przekazane kolejnej osobie z listy.!!!

Każdy zakwalifikowany uczestnik otrzyma potwierdzenie uczestnictwa, wraz z informacją o dostępie do CyberSchool. Prosimy o dokonanie zapłaty za zakwalifikowanych uczestników w wysokości 100% kwoty kosztu szkolenia w nieprzekraczalnym terminie 30 kwietnia br.

Stosowne faktury VAT zostaną wystawione i przesłane po otrzymaniu płatności na konto bankowe.

**Stowarzyszenie Rynków Finansowych ACI Polska**

ul. Wilcza 31 lok. 1A 00-544 Warszawa

NIP: 525-21-02-010 REGON: 012799548

05 1020 1068 0000 1002 0076 6089

PKO BP S.A PKO BP S.A.Oddział 6 w Warszawie ul. Puławska 15, 02-515 Warszawa

Zgłoszenie powinno zawierać imię i nazwisko uczestnika, Instytucję oraz adres email.  
Adres email jest niezbędny dla stworzenia profilu użytkownika w Cyberschool.

Zapytania w kwestiach finansowych prosimy kierować do Pana Bartłomieja Małochy - Skarbnika ACI Polska  
[bartlomiej.malocha@brebank.pl](mailto:bartlomiej.malocha@brebank.pl)

W pozostałych kwestiach organizacyjnych na Państwa pytania odpowie Pan Błażej Wajszczuk  
Sekretarz ACI Polska [blazej.wajszczuk@bnpparibas.pl](mailto:blazej.wajszczuk@bnpparibas.pl) tel 501-080-576

W załączeniu zakres tematyczny Cyber School oraz szkolenia.

**Contents Advanced ALM\*Bank Cyber Preparation Course**

<b>Main topics (chapters)</b>	<b>Scope</b>
<b>Advanced ALM*Bank Cyber Preparation</b>	
<b>1. Total Bank Management</b>	12 pages
<ul style="list-style-type: none"> <li>▶ Ratios of total bank management</li> <li>▶ Separation of customer and business risk</li> </ul>	27 questions
<b>2. Legal Framework</b>	18 pages
<ul style="list-style-type: none"> <li>▶ Limitation credit risk</li> <li>▶ Minimum Risk Capacity and ICAAP</li> <li>▶ Basel II + Outlook Basel III</li> <li>▶ Consequences of Basel II/III on ALM strategies</li> </ul>	54 questions
<b>3. Transfer Pricing Method</b>	18 pages
<ul style="list-style-type: none"> <li>▶ Customer contribution</li> <li>▶ Transfer prices</li> </ul>	30 questions
<b>4. Interest Rate Risk Management</b>	10 pages
<ul style="list-style-type: none"> <li>▶ Interest gap contribution and risk analysis</li> <li>▶ Implementation of interest opinion</li> <li>▶ Interest Rate Swaps</li> </ul>	36 questions
<b>5. Basics of Nostro management</b>	18 pages
<ul style="list-style-type: none"> <li>▶ Bonds terminology and pricing</li> <li>▶ Credit Spread Risk Measurement</li> <li>▶ Instruments of CRM</li> </ul>	39 questions
<b>6. Risk Calculation</b>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>▶ Duration and PVBP</li> <li>▶ Basics Risk Management</li> <li>▶ Risk Management Methods</li> <li>▶ Risk Management Parameters</li> </ul>	23 pages
<b>TOTAL</b>	<b>100 pages</b>

- Content of the seminar:

### **Total Bank Management, state-of-the-art in interest and liquidity management in ALM**

- ▶ **Transfer pricing as a pillar of an efficient risk management philosophy**; pros and cons, feasibility, consequences for the organisation
- ▶ MTM valuation in the interest and liquidity books
- ▶ separate management of interest, liquidity and credit spread risk in the banking book
- ▶ **Limits and stress tests for interest and liquidity risk in an ICAAP environment**
- ▶ **Impacts of LCR and NSFR on bank strategies**

### **MTM management of interest and liquidity risk**

- ▶ MTM measurement of interest and liquidity risks
- ▶ **MTM management impulses from mapping customer products with undefined maturity** and/or interest sensibilities and non-interest bearing assets and liabilities
- ▶ **Model books to manage important products** without direct hedging options (terms, currencies, soft options, contract terms)
- ▶ **Potentials of an efficient flow trading for the ALM**

### **Managing the Bond portfolio**

- ▶ Role of the Bond portfolio in the ALM environment: **impacts on liquidity ratios**, collateral management and impacts on ALM,
- ▶ Products at portfolio level: CDS, securitization
- ▶ Credit Spread risk measurement
- ▶ Tasks/competencies/responsibilities for the bond portfolio management in ALM

### **Equity management in ALM with a view towards Basel 3**

- ▶ Risk strategy and policy: compliance requirements in ALM
- ▶ **Consequences of higher equity requirements**
- ▶ Stress tests as a basis for the necessary equity buffer (ICAAP management)

### **Considering IFRS valuations in ALM management**

- ▶ Bridging the gap between national legislation and IFRS when valuing ALM results
- ▶ Measures to reduce return volatility, macro hedging and IFRS hedge accounting
- ▶ A system for setting up hedge accounting in the banking book

### **PC simulation for advanced ALM management**

- ▶ Using ALM instruments to separately manage interest, liquidity and credit spread risk
- ▶ Setting limits under MTM and IFRS valuation criteria

- ▶ **Introducing equity management into ALM**
- ▶ Optimising the risk/return ratio under the new Basel 3 regime

