



Komisja  
Nadzoru  
Finansowego

## Seminarium „Bazylea II – nadzorcza ocena wniosków o zgodę na stosowanie metod zaawansowanych na potrzeby szacowania kapitału regulacyjnego z tytułu ryzyka kredytowego w bankach: kluczowe elementy oraz wskazówki dla banków planujących złożenie wniosków”

Data: 10 kwietnia 2008 (czwartek)

Miejsce: Centralny Ośrodek Doskonalenia Nauczycieli (CODN),  
Warszawa, Al. Ujazdowskie 28 (Aula, piętro II)

### **Cel**

---

Celem seminarium jest wyjaśnienie procesu oceny wniosków banków o zgodę na stosowanie metod zaawansowanych do obliczania regulacyjnego wymogu kapitałowego z tytułu ryzyka kredytowego. W czasie seminarium wskazane będą pierwsze wnioski i doświadczenia płynące z przeprowadzonych ocen nadzorczych w bankach.

### **Kto powinien wziąć udział?**

---

Kierujący projektami NUK w bankach, członkowie zarządu odpowiedzialni za wdrożenie NUK oraz pracownicy pionów ryzyka. Seminarium jest przeznaczone dla banków, które już przygotowały wnioski o zgodę na stosowanie metod zaawansowanych lub planują wystąpienie z wnioskiem w tym zakresie.

### **Forma**

---

Seminarium będzie miało formę prezentacji połączonych z dyskusją. Przedstawione także zostaną konkretne przykłady napotkanych problemów identyfikowanych w bankach w ramach oceny wniosków o zgodę na stosowanie metod zaawansowanych na potrzeby szacowania kapitału regulacyjnego z tytułu ryzyka kredytowego.

### **Harmonogram czasowy**

---

Rejestracja uczestników na seminarium rozpocznie się od godziny 8.30  
Rozpoczęcie seminarium o godzinie 9.00  
Seminarium zakończy się o godzinie 14.00

### **Zgłoszenia: liczba miejsc ograniczona**

---

#### **Kontakt**

E-mail: grzegorz.drabarek@knf.gov.pl

Telefon : +48 22 5487 252

#### **Inne informacje**

Seminarium będzie miało miejsce w siedzibie Centralnego Ośrodka Doskonalenia Nauczycieli, Warszawa, Al. Ujazdowskie 28 przy pl. Trzech Krzyży (Aula, piętro II)

**Opłaty:** Seminarium bezpłatne. Uczestnicy otrzymają materiały szkoleniowe.

**Pytania:** Logistyka: kontakt z Panem Grzegorzem Drabarkiem

Tel +48 22 5487 252, e-mail: grzegorz.drabarek@knf.gov.pl

Program: kontakt z Panem Tomaszem Piwowarskim

Tel +48 22 6342 317, e-mail: tomasz.piwowarski@knf.gov.pl

## PROGRAM

10 kwietnia 2008 r. (czwartek)

**Centralny Ośrodek Doskonalenia Nauczycieli (CODN)  
Warszawa, Al. Ujazdowskie 28 (Aula, piętro II)**

Godzina	Temat
8:30-9:00	Rejestracja uczestników
9:00-9:15	Oficjalne otwarcie seminarium <i>Stanisław Kluz, Przewodniczący Komisji Nadzoru Finansowego</i>
9:15-10:00	Ramy prawne procesu oceny wniosków na stosowanie metod zaawansowanych na potrzeby szacowania kapitału regulacyjnego w bankach oraz zasady współpracy nadzorca macierzystego i goszczącego w tym zakresie <i>Piotr Bednarski, Dyrektor Departamentu Inspekcji UKNF i przewodniczący zespołu ds. nadzorczej oceny modeli ryzyka (walidacji nadzorczej) w UKNF</i>
10:00-10:15	Pytania i dyskusja
10:15-10:45	Przerwa na kawę
10:45-11:45	Kluczowe etapy i aspekty nadzorczej oceny wniosków o zgodę na stosowanie metod zaawansowanych w bankach na potrzeby szacowania kapitału regulacyjnego z tytułu ryzyka kredytowego <i>Tomasz Piwowarski, Naczelnik Wydziału Nadzoru Bankowego w Departamencie Inspekcji UKNF, kierujący zespołami prowadzącymi ocenę nadzorczą wniosków w bankach</i>
11:45-12:15	Pytania i dyskusja
12:15-13:15	Wyzwania i problemy występujące w bankach ubiegających się o zgodę na stosowanie metod zaawansowanych dla celów regulacyjnych w zakresie ryzyka kredytowego– wskazówki dla przyszłych aplikantów <i>Krzysztof Owczarek, kierujący Sekcją ds. Metod Pomiaru Ryzyka w Departamencie Inspekcji UKNF, kierujący zespołami prowadzącymi ocenę nadzorczą wniosków w bankach</i> <i>Krzysztof Jarosz, ekspert ds. modeli ryzyka w Sekcji ds. Metod Pomiaru Ryzyka w Departamencie Inspekcji UKNF</i>
13:15-13:45	Pytania i dyskusja
13:45-14:00	Podsumowanie <i>Piotr Bednarski, Dyrektor Departamentu Inspekcji UKNF i przewodniczący zespołu ds. nadzorczej oceny modeli ryzyka (walidacji nadzorczej) w UKNF</i>