

Objectius

El Club d'Alumnes de l'Institut d'Estudis Financers en col·laboració amb la Delegació per a Catalunya de l'Institut d'Analistes Financers i EFPA-Espanya, i amb el suport de la Borsa de Barcelona i del Departament d'Economia i Finances de la Generalitat de Catalunya organitza la **II Jornada de Mercats i Riscs Financers**, centrada en la implementació i valoració de models de risc de mercat, crèdit i operacional, en base a la nova normativa de Basilea.

La jornada es dividirà en dues parts, en la primera d'elles es comentaran els nous avanços en risc operacional i de mercat, així com una visió general del perfil professional del gestor de risc en les institucions financeres. En la segona part s'aprofundirà en la validació dels models de riscos i el paper del regulador en aquest camp.

Participants

Professionals d'entitats financeres com gestors, analistes de riscos, assessors, etc.; consultors, inversors amb coneixements avançats, i qualsevol persona interessada en profunditzar en l'àmbit del control de riscos financers.

Coordinador

Salvador Torra Professor, *Facultat d'Econòmiques Universitat de Barcelona*
Col·laborador acadèmic, *IEF*

Organitza

- Club d'Alumnes IEF
- EFPA-Espanya
- Instituto Español de Analistas Financieros, *IEAF Delegació per a Catalunya*

Col·laboradors

- Borsa de Barcelona
- Departament d'Economia i Finances, *Generalitat de Catalunya*

Requisits

La inscripció a la Jornada es regeix per les condicions internes d'admissió. L'abonament s'haurà de realitzar amb antelació. La no assistència es notificarà a l'IEF dos dies abans de l'inici de la Jornada, com a mínim. En cas contrari s'haurà d'abonar el 100% de l'import.

Inscripció: 250 euros

Aquesta Jornada gaudeix d'un **50% de descompte** per a participants de les entitats membres del Patronat de l'IEF, Club d'Alumnes IEF, membres IEF, membres d'EFPA-Espanya i entitats membres de Borsa de Barcelona, prèvia justificació de les entitats organitzadores i col·laboradores.

Programa

- 8:50 Registre participants
- 9:00 Inauguració
Miquel Salazar,
Director general de Política Financera i Assegurances,
Generalitat de Catalunya
- 9:10 Presentació de la Jornada
Josep Soler, Secretari general, *IEF*
Xavier Adserà, President, *IEAF Delegació per a Catalunya*
Carlos Tusquets, President, *EFPA-Espanya*
David Murano, Cap de Gestió de Risc Financer, *Caixa d'Enginyers*
Salvador Torra, Coordinador de la Jornada
- 9:20 Sessió inaugural. Integració de models en el sector financer
Ramon Trias, President-director general, *AIS*
- 10:00 El fòrum de regulació bancària i Basilea II.
La creació d'una cultura de gestió de risc
Brandon Davies, *Retail Market Risk Manager, Barclays Bank*
i Managing Director, GARP Risk Academy
- 10:45 Coffee-break
- 11:15 Implicacions dels canvis en l'acord de capital de Basilea sobre risc de mercat
David Murano, Cap de Gestió de Risc Financer, *Caixa d'Enginyers*
- 12:00 Solucions en la gestió del risc operacional
Santiago Carrillo, Doctor en Matemàtiques i Director,
Rislab-Madrid
- 12:45 Risc de crèdit: decisions al voltant de la conformitat IRB
Omar Akkor, Director Espanya, Portugal i França, *KMV*
- 13:30 Gestionant el risc de crèdit mitjançant la titulització. El model americà
Alicia Reyes, *Managing Director Fixed Income, Spain Bear Stearns*
-
- 16:00 Validació d'enfocaments avançats: visió actual
Jorge Martínez Blanes, Cap de Grup de Tresoreria i Models de Gestió de Riscs de la Direcció General de Supervisió,
Banco de España
- 16:45 Basilea II, una oportunitat de canvi
Oriol Ordax, Sotsdirector general director de l'Àrea de Gestió Estratègica del Risc, *La Caixa*
- 17:30 Coffee-break
- 18:00 Com afrontar el marc d'integració de riscos. Efectes de diversificació i concentració
Tomás Varela, Director de Control, Sotsdirector general,
Banc Sabadell
- 18:45 Basilea II. Procés d'implementació de models avançats.
Experiències en validació
Ricard Climent, Director de l'Àrea de Riscs, *Caixa Catalunya*
- 19:30 Cloenda de la Jornada
Salvador Torra, Coordinador de la Jornada
David Murano, Cap de Gestió de Risc Financer, *Caixa d'Enginyers*

Implementació i Validació de Models de Risc

Dades personals

JR 2 - 2006

Nom i cognoms

Data de naixement

Adreça

CP

Població

Telèfon

Mòbil

Nivell d'estudis

Dades professionals

Empresa

Sector

Càrrec

Adreça

CP

Població

Telèfon

Fax

E-mail

Dades facturació

NIF/CIF

Nom o raó social

Adreça

Contacte administratiu

Les dades que ens ha facilitat, s'incorporaran a un fitxer informatitzat del qual és responsable la Fundació Privada Institut d'Estudis Financers, a Gran Via, 670, 2n del 08010-Barcelona, i CIF G-59.190.850 per a realitzar-ne el tractament necessari a fi i efecte de fer-li arribar per correu electrònic/correu postal, informació de les activitats de la Fundació. Tant les dades com el fitxer estan emparats per les LLeis 15/1999 i 34/2002, que estableixen que pot dirigir-se a l'adreça indicada per tal d'exercir els drets d'oposició, accés, rectificació i cancel·lació de les seves dades.

Forma de pagament

Taló nominatiu a Fundació Privada Institut d'Estudis Financers

Transferència bancària al compte núm. 0182-5734-32-0201.507.077
(trameteu-nos la còpia del comprovant)

Signatura de l'assistent

Butlleta



Borsa de Barcelona



Generalitat de Catalunya
**Departament d'Economia
i Finances**

Implementació i Validació de Models de Risc

II Jornada de Mercats i Riscs Financiers

Barcelona, 18 de maig del 2006
Sala d'Actes de la Borsa de Barcelona

