

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 **III Jornada de Mercats i Riscs Financers**, centrada en la importància que posseeix el capital econòmic, la seva òptima assignació com a recurs escàs i la seva vinculació amb el capital regulatori.

La jornada inclourà el següent: ponències de caire tècnic impartides per directius d'empreses especialitzades en la gestió del risc; aportacions més globals des de l'òptica del regulador i d'empreses consultores; i experiències i millors pràctiques d'entitats financeres. Per fi, una taula rodona sobre el procés d'auto-avaluació del capital a càrrec de responsables de control del risc d'entitats de crèdit.

En definitiva, aquesta jornada és una oportunitat única per debatre un tema especialment important per al sector financer però que, recentment, ha adquirit una gran rellevància en l'actual conjuntura de restriccions de liquiditat en el sistema.

Participants

Professionals d'entitats financeres en diverses àrees vinculades a la inversió i al risc; consultors, acadèmics, 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*

Organitzen

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

Col·laboren

- 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: 280 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
Ferran Sicart,
Director general de Política Financera i Assegurances,
Generalitat de Catalunya
- 9:10** Presentació de la Jornada
Josep Soler, Secretari general, *IEF*
Alberto Moro, President, *IEAF Delegació per a Catalunya*
Carlos Tusquets, President, *EFPA-Espanya*
Salvador Torra, Coordinador de la Jornada
- 9:20** Sessió inaugural. Capital econòmic i entorns adversos
Esteban Sánchez Pajares, Soci-director de l'Àrea de Banca, *AFI*
- 10:00** "Let's stress! El mètode RDF de stress testing per a rics de crèdit"
Ramon Trias, President-director general, *AIS*
- 10:45** Coffee-break
- 11:15** Experiències de Models personalitzats de Riscs (I). Integració en la gestió: reptes i experiències
David García Martín, Responsable de Models i Instruments a l'Àrea de Riscs Negocis a Espanya, *BBVA*
- 12:00** *Advanced Stress Testing for Credit VaR for Economic Capital and Pilar II*
Suhas Kayak, Director de Solucions de Basilea II i Capital Econòmic, *SunGard BancWare*
- 12:45** La integració a la gestió dels models de riscs
Fernado Foncea, Senior Manager Sector Financer, *Deloitte*
- 13:30** El procés d'auto-avaluació del capital de les entitats de crèdit: capital econòmic i capital regulatori
Juan Serrano García, Coordinador de la implantació del Pilar 2, Direcció General de Supervisió, *Banco de España*
-
- 16:00** Experiències de Models personalitzats de Riscs (II). La funció de validació interna al model de gestió del risc: perspectives futures
Ricard Climent Meca, Director de l'Àrea de Riscs, *Caixa Catalunya*
- 16:45** Agregació i assignació de capital: observacions i suggeriments
Santiago Carrillo, Doctor en Matemàtiques (París i Complutense)
Director, *Risklab-Madrid*
- 17:30** Col·loqui: El Procés d'auto-avaluació del Capital (PAC): Beneficis i Dificultats
David Murano, Director de Gestió Global del Risc, *Caixa Enginyers*
Josep Castro, Director Divisió de Control, *Caixa Terrassa*
Joaquim Pascual Cañero, Director de Control de Risc, *Banc Sabadell*
- 18:30** Cloenda de la Jornada
Salvador Torra, Coordinador de la Jornada

Capital econòmic versus capital regulatori

Dades personals

JR 3 - 2008

Nom i cognoms

Data de naixement

Adreça

CP

Població

Telèfon

Mòbil

Nivell d'estudis (especificar)

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. 0182-6035-4902.0150.7074 (trameteu-nos la còpia del comprovant)

Signatura de l'assistent

Butlleta



Borsa de Barcelona



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

Capital econòmic versus capital regulatori en l'actual conjuntura financera

III Jornada de Mercats i Riscs Financers

Barcelona, 29 d'abril del 2008
Sala d'Actes de la Borsa de Barcelona

