

Executive Forum Eventos Encuentros de Negocios

Circular de Recursos Propios del Banco de España

Basilea II

Madrid

5 de Febrero 2009

La Circular de Recursos Propios del Banco de España 3/2008 supone la adaptación de la legislación española de solvencia al Acuerdo de Convergencia Internacional de Medidas y Normas de Capital del Comité de Supervisión Bancaria del Banco Internacional de Pagos (BASILEA II) de junio de 2004.

Inscribirse
ahora

917 505 512
info@exeforum.com

Organizadores

HIGH TECH
HOTELES



Directora del Curso. Pilar Hoyo (BANCAJA)

- Licenciada en Administración y Dirección de empresas y Licenciada en Ciencias Actuariales por la Universidad de Valencia.
- Comenzó su trayectoria profesional en Bancaja en 2001, en el departamento de Gestión Global del Riesgo.
- Implantación del Nuevo Acuerdo de Capitales de Basilea.
- Participación en el Proyecto Sectorial de Control Global del Riesgo de CECA en Madrid.
- Colaboración en Londres con el Equipo de titulización español de JPMorgan Securities.
- Desarrollo in-house del motor de cálculo de capital de Basilea.
- Profesora del Módulo de Titulización del Master Financiero y Bursátil de la Fundación de Estudios Bursátiles y Financieros.

Quiénes deben asistir

- Directores de Contabilidad de entidades financieras
- Auditores
- Responsables de Riesgos de bancos y cajas de ahorro
- Analistas de Riesgos
- Directores Financieros
- Interventores

Lugar de Celebración de las Jornadas

Hotel HIGH TECH NUEVA CASTELLANA
C/María Tubau 16
28050 Madrid

Fecha y Horario

5 de febrero de 2009
9.00 – 18.30 horas



Programa del Evento

1. Recursos Propios Computables

- Elementos que componen los Recursos Propios Computables
- Principales diferencias con los Recursos Propios Computables definidos en la Circular 5/93

2. Requerimientos de recursos propios por riesgo de crédito

- Medición del riesgo de crédito: Método estándar

- Categorías de exposición
- Cálculo de las exposiciones ponderadas por riesgo de crédito
- Entidades de Calificación elegibles (ECAI)

- Medición del riesgo de crédito: Método IRB

- Categorías de exposición
- Cálculo de las exposiciones ponderadas por riesgo de crédito
- Requisitos para la utilización del método

- Reducción del riesgo de crédito

- Técnicas de mitigación del riesgo admisibles
- Requisitos para la aplicación de las técnicas de mitigación
- Tratamiento de los desfases de vencimiento
- Combinaciones de técnicas de mitigación del riesgo

- Titulización

- Definición y ámbito de aplicación
- Cálculo de las exposiciones ponderadas por riesgo de crédito
- Método Estándar
- Método IRB

3. Requerimiento de recursos propios por riesgo de contraparte

- Métodos aplicables
- Combinaciones de métodos
- Acuerdos de compensación

4. Tratamiento de otros riesgos

- Riesgo de tipo de cambio
- Riesgo de precio de la cartera de negociación
- Riesgo de liquidación y entrega de la cartera de negociación

5. Requerimientos de recursos propios por riesgo operacional

- Métodos aplicables
- Requisitos para la aplicación de los distintos riesgos
- Mecanismos de transferencia de riesgos

6. Límites a los grandes riesgos

7. Gobierno interno de las entidades y autoevaluación de capital

8. Obligaciones de información al mercado

9. Información periódica a rendir al Banco de España

- Repaso a la estructura y contenido de los futuros estados RP de declaración de solvencia al Banco de España
- Información general (RP10 y RP11)
- Riesgo de crédito (RP21 a RP27)
- Riesgo de mercado (RP31 a RP35)
- Riesgo operacional (RP41 a RP43)
- Enlace Contabilidad-Solvencia (RP00)
- Riesgo de tipo de interés (RP51 a RP53)
- Grandes riesgos (RP60-RP61)



Información y suscripciones

Executive Forum Eventos
Ronda Caballero de la Mancha, 81
28034 Madrid
Tel. 91 750 55 12
info@exeforum.com
www.exeforum.com

Lugar de las Jornadas

Hotel HIGH TECH NUEVA
CASTELLANA
C/María Tubau 16
28050 Madrid

Fecha y Horario

5 de febrero de 2009
9.00 – 18.30

Precio por asistente 750 € + 16% IVA

El precio incluye almuerzo, cafés y documentación

Es imprescindible haber realizado el pago para poder asistir al evento

CANCELACION

Deberá ser comunicada por escrito.

Si se comunica hasta 2 días laborables antes del evento, se devolverá el importe menos un 10% en concepto de gastos administrativos. Pasado este periodo no se reembolsará el importe de la inscripción pero se admite la sustitución de su plaza, que deberá ser notificada por escrito hasta un día antes de la celebración del evento.

DOCUMENTACIÓN

Si no puede asistir al evento y está interesado en la documentación, póngase en contacto con nosotros y le indicaremos cómo conseguirla.

Tel. 91 750 55 12
info@exeforum.com

FORMACIÓN "IN COMPANY"

Si necesita formación para su empresa, solicite información de nuestro catálogo de productos

www.exeforum.com
Tel. 91 750 55 12
chiva@exeforum.com

PATROCINIO DE EVENTOS

Infórmese de las opciones de patrocinio que tenemos a su disposición.

Tel. 91 750 55 12

Inscríbese ahora

917 505 512

info@exeforum.com

