

Objectius

La jornada presentarà, a través de ponències tècniques i d'aportacions basades en l'experiència d'institucions, el panorama actualitzat de l'*stress testing* en institucions financeres.

Basat en una anàlisi d'escenaris, l'*stress testing* avalua els impactes possibles en un balanç o en una cartera si es produïssin determinats esdeveniments. Aquesta jornada permetrà analitzar solucions per a la gestió del risc proposades per empreses especialitzades, contribucions globals des del punt de vista del regulador, d'empreses de qualificació i d'empreses consultores, i experiències bancàries.

En definitiva, és una ocasió única a Barcelona per a tractar un tema que ha adquirit encara més rellevància durant i després de la crisi financera recent.

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*
- GARP Barcelona Chapter

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, GARP Barcelona Chapter 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
- 9:05** Presentació de la Jornada
Josep Soler, Director general, *IEF*
Josep Maria Antúnez, Vicepresident, *IEAF Delegació per a Catalunya*
Carlos Tusquets, President, *EFPA-Espanya*
- 9:15** Introducció
Salvador Torra, Coordinador de la Jornada
David Murano, Director regional, *GARP*
- 9:25** Sessió inaugural. Els reptes de la regulació financera en la postcrisi
Xavier Freixas, Catedràtic d'Economia Financera, *UPF i CEPR*
- 10:05** Formalització del procés de creació d'escenaris de proves de tensió
Carles Herrero, *Lead Consultant, Customer Solutions Design Group, Algorithmics Inc.*
- 10:50** Coffee-break
- 11:15** Risc de Crèdit. Del model de Vasicek al mètode RDF: superant pas a pas les hipòtesis restrictives
Ramon Trias, President-director, *AIS*
- 12:00** Anàlisi de la morositat en base a factors macroeconòmics
Fernando Castiñeiras, Soci, *Management Solutions*
- 12:45** Coffee-break
- 13:00** Visió del sector de titulització a Espanya i les seves perspectives
Álvaro Gil, Director de Finances Estructurades a Espanya,
Fitch Ratings
- 13:45** Exercicis d'stress en entitats de crèdit. Visió del supervisor
Juan Serrano García, Secretaria tècnica i relacions institucionals, Direcció General de Supervisió, *Banco de España*
- 14:30** Cloenda
Salvador Torra, Coordinador de la Jornada

Stress Testing per a Institucions Financeres

Dades personals

JR 4 - 2009

Nom i cognoms

Data de naixement

Adreça

CP

Població

Telèfon

Mòbil

E-mail

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 faciliteu amb aquesta butlleta, s'incorporen a un fitxer registrat en l'Agència Espanyola de Protecció de Dades que utilitzarem per trametre-li informació sobre les nostres activitats formatives i, si escau, per avaluar l'adequació del curs sol·licitat així com per comunicar-nos amb vostè sobre altres qüestions relacionades amb el mateix. El responsable del fitxer és la Fundació Privada Institut d'Estudis Financers [FPIEF], amb domicili a la Gran Via de les Corts Catalanes, núm. 670, 2n, de Barcelona (adreça electrònica: infoief@iefweb.org). En qualsevol moment pot adreçar-se a l'FPIEF per exercir, gratuïtament, el dret d'oposició, accés, rectificació o cancel·lació de les seves dades personals, així com per oposar-se a la recepció de correus electrònics o comunicats amb contingut publicitari.

Forma de pagament

- Taló nominatiu a Fundació Privada Institut d'Estudis Financers
- Transferència bancària al compte núm. 0182-6035-49-0201507074 (trameteu-nos la còpia del comprovant)

Signatura de l'assistent

Butlleta



Borsa de Barcelona



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



Stress Testing per a Institucions Financeres

IV Jornada de Mercats i Riscs Financers

Barcelona, 27 d'octubre del 2009
Sala d'Actes de la Borsa de Barcelona

