

Basilea III: Posicionamiento estratégico sobre nuevos estándares de solvencia y liquidez

Duración	8 horas Madrid, 15 de febrero de 2011
Titulación	Certificado de Asistencia
Docentes	Equipo profesional de Intermoney
Dirigido a	Profesionales, responsables o encargados en la elaboración y análisis de planes estratégicos, presupuestos operativos pertenecientes a departamentos de planificación, control de gestión o control de riesgos, departamentos de tesorería y/o auditoría interna en entidades financieras, así como cualquier persona interesada en profundizar en sus conocimientos en esta materia.
Objetivos generales	Dotar a los asistentes de los conceptos más actualizados en la definición, planificación y control del capital de una Entidad Financiera, así como en la definición y gestión de los nuevos estándares de liquidez.
Objetivos específicos	Transmitir a los participantes los conocimientos, metodologías, fases e implicaciones de la evolución de la regulación desde Basilea I hasta Basilea III en los procesos de planificación, control y gestión de los riesgos que enfrenta una Entidad Financiera.
Metodología	El modelo formativo está enfocado a ofrecer respuestas individuales y eficaces en todo momento, prestando especial atención a la aplicabilidad de los aspectos tratados en la formación. Nuestro apoyo continuo asegura el progreso personal de cada uno de los asistentes, adaptándonos al ritmo de las posibilidades y conocimientos previos. Se combinarán las explicaciones técnicas con el análisis de casos reales guiados por el docente.
Calendario	15 de febrero de 2011 Grupos reducidos
Desarrollo sesiones*	Curso abierto a participantes de cualquier EECC Una jornada seguida en sesiones de 4 horas por la mañana y 4 horas por la tarde.
Horario	Mañana: de 9:30 a 13:30 Tarde: de 15:00 a 19:00
Precio	1.200€ + IVA por asistente

Programa

1. Gestión del capital bajo incertidumbre
 - a. Basilea II y la optimización de la gestión bancaria
 - i. Perspectiva RRPP vs Perspectiva recursos ajenos
 - ii. Riesgo Bancario y necesidad de capital (regulatorio/económico)
 - iii. Alineación del capital económico y el regulatorio
 - b. Requerimientos de capital
 - c. Coeficiente de solvencia por riesgo de crédito, mercado y operacional
 - d. Otros riesgos Pilar II. Proceso de Autoevaluación de Capital (PAC)
 - i. Riesgo de concentración
 - ii. Riesgo estructural del TI
 - iii. Riesgo de liquidez
2. La prueba de Fuego. Crisis de Liquidez
 - a. Dificultades y fallos en la aplicación de Basilea II
 - b. De riesgos como restricción a riesgos como cultura
3. Propuestas de Basilea III
 - a. Redefinición del Capital
 - i. Componentes del capital y sus nuevos límites y mínimos
 - ii. Redefinición de Tier 1
 - iii. Redefinición de Tier 2
 - iv. Redefinición de intereses minoritarios y ajustes regulatorios
 - v. Transición en el reconocimiento de componentes definidos según criterios de Basilea II
 1. Requerimientos mínimos
 2. Deduciones regulatorias
 3. Intereses minoritarios en entidades no financieras
 4. Inyección de capital público
 5. Cláusulas en bonos subordinados
 6. Modificación de las reglas de cómputo de híbridos
 - b. Redefinición de riesgos
 - c. Otros Ratios. Ratio de Apalancamiento
 - d. Entrada en vigor.
4. Riesgo de liquidez
 - a. Hoja de ruta
 - b. Ratio de cobertura de liquidez
 - c. Ratio de financiación estable neta
 - d. Problemática actual
 - e. Perspectivas de futuro
5. Resultados del QIS
 - a. Revisión de la situación
 - b. Implicaciones estratégicas

Intermoney formación

Pza. Pablo Ruiz Picasso, 1
Edificio Torre Picasso, planta 23 - 28020 Madrid
Tel. +34 91 432 64 81 - +34 91 432 64 64
intermoneyformacion@grupocimd.com
<http://www.intermoney.es>

