

Curso de Medición y Gestión del Riesgo de Interés Estructural de Balance

Duración	20 horas Madrid, 5, 6 y 7 de abril de 2011
Titulación	Certificado de Asistencia
Docentes	Equipo profesional de Intermoney
Dirigido a	Profesionales, asignados a funciones de control y riesgos de balance, gestión global del riesgo, especialistas en ALM en departamentos de tesorería y/o planificación y control de gestión y auditoría interna.
Objetivos generales	Proporcionar a los asistentes un sólido conocimiento de sus usos y posibilidades para la gestión del riesgo de tipos de interés en entidades de crédito, en el entorno normativo del Pilar 2 de Basilea II y circular de Solvencia de EECC de Banco de España 3/2008, aprobada el 22 de mayo de 2008.
Objetivos específicos	Proporcionar a los asistentes una visión global de un modelo de medición y gestión del riesgo de interés en entidades de crédito.
Metodología	<p>Nuestro modelo formativo está enfocado a ofrecer respuestas individuales y eficaces en todo momento, prestando especial atención a la aplicabilidad inmediata de todos los aspectos mostrados en la formación. Nuestro apoyo continuo asegura el progreso personal de cada uno de los asistentes, adaptándonos al ritmo de sus posibilidades.</p> <p>Se combinarán las explicaciones técnicas con el análisis de casos reales guiados por el docente.</p>
Calendario	5, 6 y 7 de abril de 2011 Grupos reducidos
Desarrollo sesiones*	Curso abierto a participantes de cualquier EECC Dos jornadas seguidas en sesiones de 4 horas por la mañana y 4 horas por la tarde, seguidas de una tercera jornada de 4 horas por la mañana.
Horario	Mañana: de 9:30 a 13:30 Tarde: de 15:00 a 19:00
Precio	2.000€ + IVA por asistente

Programa

1. Identificación del Riesgo de Interés
 - 1.1. Introducción
 - 1.2. Identificación de elementos sensibles y no sensibles
 - 1.3. Tratamiento de partidas sensibles
 - 1.4. Definición del plan de cuentas
 - 1.5. Proceso ALM
 - 1.6. Fuentes de riesgo de interés
 - 1.7. Revisión normativa

Anexo 1.1: Inventario de renta fija

Anexo 1.2. Correspondencia entre instrumentos bancarios y de renta fija
2. Medición del Riesgo de Interés sobre margen financiero
 - 2.1. Introducción a las medidas de riesgo
 - 2.2. Método clásico: gap de reprecio
 - 2.3. Métodos basados en la simulación de escenarios
 - 2.3.1. Escenarios deterministas
 - 2.3.2. Escenarios aleatorios (Earnings at Risk)
 - 2.4. Aplicación a presupuestación y seguimiento presupuestario
 - 2.5. Hipótesis sensibles del modelo: Backtesting
 - 2.6. Modelo de informes

Anexo 2.1: Precios internos de transferencia
3. Medición del Riesgo de Interés sobre valor económico
 - 3.1. Del análisis del margen al análisis del valor: El concepto de valor económico
 - 3.2. Análisis de sensibilidad del valor económico
 - 3.2.1. Medidas clásicas de duración
 - 3.2.2. Medidas de duración basadas en revaluación completa
 - 3.2.3. Key rate duration: descomposición de la duración
 - 3.3. Aspectos relevantes en el análisis de valor y sensibilidad
 - 3.3.1. Value at Risk
 - 3.3.2. Influencia de la opcionalidad
 - 3.3.3. Opciones sobre tipos de interés
 - 3.3.4. Prepagos
 - 3.3.5. Cuentas sin vencimiento
 - 3.4. Modelo de informes

Anexo 3: Modelización de la opcionalidad
4. Análisis de los efectos de la crisis financiera actual sobre la gestión de riesgos
 - 4.1. Integración del riesgo de liquidez y riesgo de interés
 - 4.2. Modelización de las curvas de tipos problemática en la curva depo-swap
 - 4.3. Documentación de los escenarios de estrés

Programa cont.

5. Gestión del riesgo de tipos de interés
 - 5.1. Análisis del proceso de gestión: límites al riesgo de interés
 - 5.2. Estrategias de gestión del riesgo de tipo de interés
 - 5.3. Estrategias de cobertura: contabilidad de coberturas

6. Implicaciones de la nueva normativa de Banco de España: Circular de Solvencia 3/2008
 - 6.1. Tratamiento del riesgo de interés en al circular de solvencia 3/2008
 - 6.2. Estados de supervisión del riesgo de tipo de interés RP51, 52 y 53
 - 6.3. Plan de contingencia de riesgo de tipo de interés

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>

