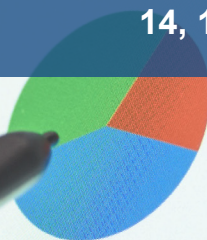


CURSO

GESTIÓN DE RIESGOS

14, 15, 16, 28, 29 y 30 de enero de 17 a 21 horas



“All Finance professionals need to understand risk, and, to be successful, they need a solid understanding of risk” (Hull, 2018)

“The ability to effectively manage risk is the single most important characteristic separating financial firms that are successful and survive over the long run from firms that do not” (Coleman, 2011)

Fundación de Estudios Bursátiles y Financieros
Palau Boil D’Arenós, edificio de la Bolsa de Valencia
C/ Libreros 2 y 4 – Valencia, CP: 46002

Tlf: 96 387 01 48 - Fax: 96 387 01 95 - Email: jsixto@febf.org - www.febf.org

OBJETIVOS

Se analizarán las distintas formas a través de las cuales los riesgos son cuantificados y gestionados por empresas e instituciones financieras. Basilea III y IV exigen nuevas competencias y mayores exigencias para las entidades financieras. De manera específica, se profundizará en la medición y gestión del riesgo de mercado, riesgo de crédito, riesgo operacional y riesgo de liquidez; y todo ello, no sólo desde una perspectiva doméstica, sino también teniendo en consideración la regulación internacional sobre riesgos.

Objetivos concretos:

- Identificar los principales tipos de riesgo en una organización.
- Revisar y aplicar las técnicas de medición de riesgos de mercado, de crédito, operacional y de liquidez.
- Manejar herramientas estadísticas diseñadas para la medición de las diferentes clases de riesgo.
- Discutir ejemplos de casos prácticos de la realidad en los que se ponen de manifiesto la gestión y medición de riesgos por parte de las organizaciones.
- Conocer la regulación financiera sobre riesgos.

DIRIGIDO A:

Profesionales del departamento de riesgos de entidades financieras o interesados en desarrollar su carrera profesional en esta área. Tesoreros, directores financieros, gestores de riesgos, analistas de crédito.

PROFESOR

Dr. Francisco Sogorb Mira



Licenciado en Ciencias Económicas y Empresariales, Máster en Software de Gestión Empresarial SAP-ERP y Doctor en Administración y Dirección de Empresas, es Profesor Titular del Área de Economía Financiera en la Universidad CEU Cardenal Herrera desde 1995. Entre otros reconocimientos, en 2007 recibió el Premio Ángel Herrera a la Mejor Labor Docente de la Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas en Elche de la Universidad CEU Cardenal Herrera. Es autor de distintos trabajos de investigación presentados y debatidos en diferentes foros científicos de carácter nacional e internacional. Además es Coordinador del Programa de Doctorado de Finanzas de la Universidad CEU Cardenal Herrera desde octubre de 2015. Asimismo, desempeña el cargo de Coordinador del Área Departamental de Finanzas y Contabilidad del Departamento de Economía y Empresa en la Facultad de Derecho, Empresa y Ciencias Políticas de la Universidad CEU Cardenal Herrera desde septiembre de 2009. Anteriormente, ha desempeñado los cargos de Director Financiero en el sector de la automoción, Analista de Valores en dos Sociedades de Valores y Bolsa, y Consultor Financiero en el sector cementero. Asimismo, es Consultor Certificado en SAP Financials con ID 0010395270.



GESTIÓN DE RIESGOS

PROGRAMA

La gestión de riesgos bancarios implica a todos los departamentos y debe estar plenamente integrada en la organización.

1. FUNDAMENTOS DE LA GESTIÓN DE RIESGOS

- ¿Qué es el riesgo?
- ¿Cómo gestionar el riesgo?
- Apetito del riesgo
- Tipología del riesgo
- Práctica en la gestión de riesgos

2. RIESGO DE MERCADO

- Concepto y factores de riesgo de mercado
- Medidas de riesgo de mercado
- Metodología VaR
- Medida ETL
- Otras medidas de riesgo de mercado

3. RIESGO DE CRÉDITO

- Concepto y tipología
- Matrices de transición
- Medición del riesgo de crédito
- Credit Default Swaps (CDS)
- Normativa de Basilea

4. RIESGO OPERACIONAL

- Concepto y categorización
- Severidad y frecuencia de pérdidas
- Metodologías de medición del riesgo operacional
- Normativa de Basilea

5. RIESGO DE LIQUIDEZ

- Liquidez frente a solvencia
- Riesgo de liquidez en la negociación
- Riesgo de liquidez en la financiación
- Normativa de Basilea

INSCRIPCIÓN Y MATRÍCULA

Público en general: 730 €

Socios FEBF: 630 €



El curso es válido como 20 horas de formación para la recertificación EFA y EFP



Rogamos envíen la inscripción al **Curso "Gestión de Riesgos"** a la FEBF por Fax: 96 387 01 95, a través de email: jsixto@febf.org, o Internet en www.febf.org. El curso se desarrollará en las instalaciones de la FEBF los días **14, 15, 16, 28, 29 y 30 de enero** de **17 a 21 horas**.

¿Desea bonificar esta actividad con la Fundación Tripartita?

Sí



Curso bonificable a través de la Fundación Tripartita, siempre y cuando se realice la inscripción dentro de los plazos exigidos por la misma. La tramitación de la bonificación por parte de la Fundación de Estudios Bursátiles y Financieros no tiene coste adicional. En el caso de estar interesado en la bonificación debe comunicárnoslo con un mínimo de 10 días laborales de antelación.

DATOS PERSONALES

Nombre completo: _____
Dirección: _____
C.P. y Ciudad: _____
Teléfono y Email: _____

DATOS DE LA EMPRESA

Empresa: _____
CIF: _____
Cargo: _____
Dirección: _____
C.P y Ciudad: _____
Teléfono y Fax: _____
Email: _____

DATOS FACTURACIÓN:

Persona Física y NIF: _____
 Empresa y CIF: _____

FORMA DE PAGO

Transferencia bancaria (El número de cuenta se facilitará tras la recepción de la inscripción).

(*) La preinscripción del curso se rige por las condiciones internas de admisión, y por el abono de la matrícula con antelación al inicio del curso.

(**) Únicamente será reembolsada la cantidad abonada en concepto de matrícula si se comunica la baja con 24 horas de antelación a la celebración del curso.

Le informamos que sus datos de carácter personal serán incluidos en un fichero de tratamiento automatizado, titularidad de la Fundación de Estudios Bursátiles y Financieros. Conforme a lo previsto en la Ley Orgánica 15/1999, de Protección de Datos de Carácter Personal, Ud. puede ejercer los derechos de acceso, rectificación, cancelación y en su caso, oposición, enviando un escrito a tal efecto, acompañado de una fotocopia de su DNI, dirigido a: Fundación de Estudios Bursátiles y Financieros, C/ Libreros 2 y 4, 46002 Valencia, o bien a la dirección e-mail: formacion@febf.org