



Icea

Gestión de Riesgos y ALM



c u r s o s
especialización

Objetivos

Conocer adecuadamente las herramientas que permitan una mejora en la gestión y el control de riesgos, así como una gestión adecuada del activo y del pasivo.

Conocer la normativa, políticas de gestión y metodologías desde la perspectiva de los órganos de control y supervisión (DGSFP y EIOPA).

Realizar aplicaciones prácticas de análisis de riesgos.

ICEA quiere contribuir a la formación especializada en estas técnicas entre los profesionales las entidades de seguros mediante la realización de este Curso, intensivo, ampliando así las actividades de carácter financiero que viene realizando.

Programa

MÓDULO I: CONTROL DE RIESGOS EN EL MARCO DE SOLVENCIA II- MÓDULOS DE RIESGOS

Jueves 20 de junio de 09:00h a 13:30h y de 15:00h a 18:30h

Viernes 21 de junio de 09:00h a 14:00h

- Antecedentes del control de riesgos
- La gestión del riesgo en una entidad aseguradora (ERM)
- Normativa legal vigente y perspectivas según Solvencia II:
 - Aspectos cuantitativos de Solvencia II: La formulación estándar y los modelos internos de gestión de riesgos.
 - El marco de gestión cualitativo: El gobierno de las entidades y el ORSA en la futura Ley de supervisión de seguros.
 - Las facultades de supervisión sobre la gestión de riesgos.

MÓDULO II: ANÁLISIS DE RIESGOS FINANCIEROS

Lunes 24 de junio de 09:00h a 13:30h y de 15:00h a 18:30h

Martes 25 de junio de 09:00h a 13:30h

- El riesgo financiero en las compañías de seguros
- El riesgo de Solvencia II
- Herramientas de análisis del riesgo:
 - Indicadores de riesgo
 - Análisis DFA (Dynamic Financial Analysis)
 - VAR y Tail VAR

- Desarrollo de Modelos internos

Aplicación práctica del análisis del riesgo

2013



Programa

MÓDULO III: ANÁLISIS DEL RIESGO DE SUSCRIPCIÓN

Martes 25 de junio de 15:00h a 18:30h

Miércoles 26 de junio de 09:00h a 13:30h y de 15:00h a 18:30h

- Valoración del pasivo: provisiones técnicas
- Metodologías de valoración y medición de riesgos
 - Aspectos clave en Vida
 - Aspectos clave en No Vida
- Aplicación a productos y modelización
- Marco Solvencia II:
 - Best Estimate
 - Risk Margin
 - Riesgos de suscripción en la fórmula estándar

Aplicación práctica de valoración y análisis del riesgo

MÓDULO IV: INTRODUCCIÓN A LOS MODELOS INTERNOS, UTILIZACIÓN DE HERRAMIENTAS INFORMÁTICAS

Lunes 1 de julio de 09:00h a 14:00h

- Valoración "fair value" de activos y pasivos
- Medición de riesgos y pruebas de tensión
- Cálculo del capital regulatorio en función del consumo de riesgo
- Control de riesgos y Cuadro de Mandos ALM
- Asignación óptima de recursos
- Análisis de las rentabilidades obtenidas

Aplicación práctica de la evaluación de resultados

Gestión de Riesgos y ALM





DATOS DE ORGANIZACIÓN

Lugar de celebración:	El curso tendrá lugar en las Salas de Formación de ICEA, C/ López de Hoyos, 35 – 28002 Madrid y en salas informáticas externas para la realización de aplicaciones prácticas.
Fechas y Horario:	Fechas: 20, 21, 24, 25, 26 de junio de 2013 de 9:00 h a 18:30 Fechas: 21 de junio y 1 de julio de 2013 de 9:00 h a 14:00
Derechos de inscripción:	Cuota (Entidades Adheridas): 1.300 euros + I.V.A. Cuota (Entidades no Adheridas): consultar ICEA Dicha cuota incluye la asistencia al curso, documentación y certificado de asistencia. 20% de descuento a partir del segundo asistente de una misma entidad.
Condiciones generales:	La cuota de inscripción puede hacerse efectiva en las oficinas de ICEA, o bien mediante transferencia bancaria a nuestra cuenta corriente número 0081-7118-57-0001087611 del Banco Sabadell Atlántico de la C/ Juan Bravo, 51 (28006-Madrid). Las inscripciones anuladas dentro de las 48 horas anteriores al comienzo del curso deberán abonar el 50% de la cuota. La celebración del curso está condicionada a la asistencia de un número mínimo de participantes.
Las inscripciones se efectuarán por riguroso orden de recepción. Anticipe su inscripción llamando a: Lola García directo 91 142 09 44 Enviar a ICEA este boletín de inscripción antes del 15 de junio por cualquiera de los siguientes procedimientos: ICEA (López de Hoyos, 35 - 5ª - 28002 Madrid) – Fax: 91 562 35 08 - Correo electrónico: lola.garcia@icea.es - Internet: www.icea.es	

BOLETÍN DE INSCRIPCIÓN

PROGRAMA DE ESPECIALIZACIÓN EN GESTIÓN DE RIESGOS Y ALM

Rogamos inscriban a las siguientes personas:

Entidad	
D./ Dña.	
Cargo	email
D./ Dña.	
Cargo	email
Domicilio	N.I.F.
Localidad/Provincia	C.P.
Telf. contacto	Fax
Persona de contacto	
email	

Advertencia de Privacidad

Los datos de carácter personal que se faciliten mediante el siguiente boletín quedarán registrados en un fichero de Asociación ICEA, con la finalidad de gestionar los productos y servicios solicitados; remitir información y permitir la colaboración profesional. Por ello pueden ejercitar los derechos de acceso, rectificación, cancelación y oposición ante Asociación ICEA, calle López de Hoyos nº 35, 28002 Madrid.