

## **Encuentros Financieros 2013**

# **“Solvencia II y riesgo de crédito y contraparte”**

**Madrid, 3 de diciembre**

### **Presentación**

Las exigencias regulatorias de Solvencia II hacen que la gestión de los riesgos de crédito y contraparte juegue un papel cada vez más relevante para las entidades aseguradoras. Esta jornada pretende aportar una visión general sobre los aspectos normativos que afectan a estos riesgos, así como las mejores prácticas asociadas a su medición, control y gestión.

Este Encuentro Financiero está dirigido fundamentalmente a directivos y profesionales de la gestión de riesgos financieros, riesgos actuariales, ALM y auditoría interna de entidades aseguradoras.

La sesión será eminentemente práctica y didáctica. El material de trabajo estará compuesto por documentos PDF y por hojas de cálculo EXCEL diseñadas expresamente para el seguimiento de un Case Study.

# “Solvencia II y riesgo de crédito y contraparte”

### Programa

**Madrid, 3 de diciembre de 2013**

Patrocinado por:



**serfieX**  
risk management & ALM

- 09:15 h. Registro de asistentes
- 09:30 h. Presentación y bienvenida  
**M<sup>a</sup> José Salcedo**, Directora Área de Investigación de **ICEA**
- 09:40 h. APERTURA  
Perspectivas sobre el desarrollo normativo del proyecto Solvencia II  
**Fernando Moreno Gamazo**, Subdirector General de Inspección de la **DGSFP**
- 10:15 h. Utilización de Derivados para la gestión del riesgo de crédito: La nueva generación de productos de crédito  
**Alvaro Alzaga**, Head of Structured Credit Europe de **BBVA** Corporate & Investment Banking
- 11:00 h. Desayuno
- 11:30 h. Seminario práctico sobre Riesgo de Crédito y Contraparte:  
  - Técnicas para la medición y control del riesgo de crédito y contraparte: políticas, límites y reporting
  - Alternativas al tratamiento de los riesgos de crédito y contraparte en Solvencia II
  - Cómo optimizar la carga de capital regulatorio (SCR) por riesgo de crédito-contraparte**Rafael García**, Consejero Delegado de **SERFIE X**  
**Laura del Campo**, Directora de **SERFIE X**
- 13:30 h. Coloquio
- 13:45 h. Clausura

### Invitación Personal

**Lugar de Celebración:** La jornada se celebrará en las Salas de Formación de ICEA, en la calle López de Hoyos, 35 – Madrid.

**Entidades Adheridas:** Gratuito

**Entidades no adheridas:** 400 euros + 21% IVA.

**Se ruega confirmación:**

**M<sup>a</sup> Carmen Zapata** – [carmen.zapata@icea.es](mailto:carmen.zapata@icea.es) - Teléfono 91 142 09 53 – [www.icea.es](http://www.icea.es)