

## Curso de Medición y Gestión del Riesgo de Liquidez en el Ámbito de Basilea III

Gestión de nuevos ratios: implicaciones estratégicas

<b>Duración</b>	20 horas Madrid, 15, 16 y 17 de marzo de 2011
<b>Titulación</b>	Certificado de Asistencia
<b>Docentes</b>	Equipo profesional de Intermoney
<b>Dirigido a</b>	Profesionales, asignados a funciones de control y riesgos de balance, gestión global del riesgo, especialistas en ALM en departamentos financieros y/o planificación y control de gestión, tesorería y mercado de capitales, banca corporativa y auditoría interna.
<b>Objetivos generales</b>	<p>Descripción del proceso íntegro del tratamiento del riesgo de liquidez, dotando a los asistentes de la metodología y conocimientos necesarios para la medición, vigilancia, control y gestión del riesgo de liquidez, todo ello adaptado a los últimos documentos consultivos en materia de riesgo de liquidez entre los que destacan:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Principles for Sound Liquidity Risk Management and Supervision, September 2008, BCBS</li><li>▪ Guidelines on Liquidity Buffers &amp; Survival Periods, Dec 2009, CEBS</li><li>▪ Basel III: International framework for liquidity risk measurement, standards and monitoring, Dec 2010, BCBS</li></ul> <p>Dada la importancia de este último documento a lo largo del curso se analizarán detalladamente sus principales contenidos e implicaciones para la futura gestión del riesgo de liquidez.</p>
<b>Objetivos específicos</b>	Proporcionar a los asistentes una visión compacta y global de un modelo de medición y gestión del riesgo de liquidez, integrando la perspectiva de gestión interna con los requerimientos del nuevo marco regulatorio, en especial con los nuevos estados de supervisión de BdE L1 a L6 así como con la Guía de BdE y con los estándares propuestos por BCBS en Basilea III (Liquidity Coverage Ratio y Net Stable Funding Ratio).
<b>Metodología</b>	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. Se combinarán las explicaciones técnicas con el análisis de casos reales guiados por el docente.
<b>Calendario</b>	15, 16 y 17 de marzo de 2011 Grupos reducidos
<b>Desarrollo sesiones*</b>	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.
<b>Horario</b>	Mañana: de 9:30 a 13:30 Tarde: de 15:00 a 19:00
<b>Precio</b>	2.000€ + IVA por asistente

## Programa

1. Identificación del Riesgo de Liquidez
  - 1.1. Nuevo contexto internacional
  - 1.2. Concepto de liquidez
  - 1.3. Tipología de problemas de liquidez
  - 1.4. Principios BCBS
  
2. Vigilancia y Medición del Riesgo de Liquidez
  - 2.1. Indicadores de liquidez de mercado
  - 2.2. Hipótesis de comportamiento
  - 2.3. Liquidez contingente
  - 2.4. Liquidez a corto: Gap estático
  - 2.5. Liquidez estructural: Gap dinámico
  - 2.6. Análisis de desviaciones
  - 2.7. Escenarios alternativos: Liquidez en riesgo
  - 2.8. Backtesting
  
3. Gestión del Riesgo de Liquidez
  - 3.1. Elaboración del cuadro de mando: ratios de liquidez
  - 3.2. Estructura de límites
  - 3.3. Escenarios de estrés: Sistémicos, específicos y combinados
  - 3.4. Gestión activa: Colchón de activos líquidos y horizontes de supervivencia
  - 3.5. Gestión pasiva: Plan de Contingencia

Anexo: Instrumentación de la política monetaria en BCE
  
4. Buen gobierno
  - 4.1. Tolerancia al Riesgo
  - 4.2. Sistema de informes
  
5. Supervisión del Riesgo de Liquidez
  - 5.1. Circular 9/2010: Guía de Liquidez de Banco de España
  - 5.2. Estados de liquidez de BdE: L1 a L6
  - 5.3. Basilea III: Hoja de ruta
  - 5.4. Liquidity Coverage Ratio
  - 5.5. Net Stable Funding Ratio
  - 5.6. Quantitative Impact Study: Implicaciones estratégicas
  - 5.7. Proceso de supervisión continua

### 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>

