

CÁTEDRA
ASSET MANAGEMENT



GESTIÓN DE RIESGOS ESTRUCTURALES DE BALANCE: RETOS Y OPORTUNIDADES

Ponente Principal: Donald Van Deventer, SAS

Panelistas:

Moderador: Sergio Cifuentes. BBVA

Manuel Revuelta. Santander

Miguel Torres. CaixaBank

EVENTO PRESENCIAL

22 de Febrero de 2024 // 18:30 h.

Universidad Pontificia Comillas, ICADE

Sala de Conferencias

Calle Alberto Aguilera 23. Madrid

Moderador: Carles Cerdá

En un entorno tan turbulento como el actual y con tanta inestabilidad en los mercados internacionales, las entidades financieras son conscientes de la creciente importancia de una gestión más eficaz de la liquidez y de los activos y pasivos (ALM) con funciones de balance integradas en todo momento.

En este contexto, **la Cátedra de Asset Management de ICADE, El Club de Gestión de Riesgos de España y SAS** tienen el placer de invitarle a la sesión: **Gestión de riesgos estructurales de balance: retos y oportunidades**, que tendrá lugar el próximo 22 de Febrero a las 18:30 h. en la sala de conferencias de la Universidad Pontificia Comillas, ICADE, en la Calle Alberto Aguilera 23.

Durante la sesión, **Donald Van Deventer**, *Managing Director, Risk Research and Quantitative Solutions* en SAS, fundador de Kamakura Corporation y reconocido experto académico en la gestión de activos financieros dará una charla titulada: **Buenas prácticas vs prácticas habituales en la gestión de ALM: España y zona Euro** en la que repasará por qué las buenas prácticas no son siempre las prácticas más utilizadas y porque la gestión habitual de ALM fracasó recientemente en casos tan internacionalmente conocidos, incluso cumpliendo con las exigencias regulatorias de Basilea.

A continuación, celebraremos una Mesa Redonda en la que además de **Donald Van Deventer** participaran expertos en la materia como **Manuel Revuelta, CFA,FRM**, Group Vice President Structural and Liquidity Risk en Banco Santander, **Miguel Torres**, Director Banca Corporativa en La Caixa y **Sergio Cifuentes** Structural. Risk Discipline Leader en BBVA, quien además ejercerá de moderador del panel





AGENDA

18:30 **Apertura de la sesión:**

Club de Gestión de Riesgos & Cátedra de Asset Management -ICADE & SAS

18.35-19:15. **Ponencia Principal:**

Gestión de riesgos estructurales de balance: retos y oportunidades.

Donald Van Deventer, SAS

19:15-20:00. **Mesa redonda:**

Moderador: Sergio Cifuentes. BBVA


Manuel Revuelta. Santander

Miguel Ángel Torres. Caixabank.

20:00. **Clausura:**

Club de Gestión de Riesgos & Cátedra de Asset Management -ICADE & SAS

20:10-21:00. Aperitivo



Ponente Principal: Donald Van Deventer, SAS
Managing Director, Risk Research and Quantitative Solutions at SAS

Se unió recientemente al grupo de investigación de riesgos y soluciones cuantitativas de SAS. Fundó Kamakura Corporation en abril de 1990 y se desempeñó como presidente y director ejecutivo tras la adquisición de la empresa por parte de SAS en 2022. Ha estado involucrado en tareas de asesoramiento financiero que incluyen tanto gestión de riesgos como fusiones y adquisiciones. Ha trabajado en asignaciones para los municipios afectados en la quiebra del Condado de Orange, en una importante disputa de derivados entre JPMorgan y una firma de valores coreana, para Bank Negara Malaysia, el Departamento del Tesoro de los Estados Unidos, gobiernos de tres de los países de la OCDE. y muchas de las instituciones financieras más grandes del mundo.

La segunda edición del libro más reciente de Donald van Deventer, *Advanced Financial Risk Management*, fue publicada en 2013 por John Wiley & Sons. En 2003, fue coautor de *Modelos de riesgo crediticio y los Acuerdos de Basilea* con Kenji Imai. Su primer libro, *Financial Risk Management in Banking*, es uno de los libros más conocidos en su campo. Ha formado parte del consejo editorial del *Journal of Credit Risk* desde 2005. Sus principales intereses de investigación y consultoría financiera implican la aplicación práctica de la teoría financiera de vanguardia para resolver problemas críticos de gestión de riesgos financieros.

Panel:

Sergio Cifuentes. *Structural. Risk Discipline Leader en BBVA*

Manuel Revuelta. *CFA, FRM, Group Vice President Structural and Liquidity Risk. Banco Santander*

Miguel Angel Torres. *Director de Riesgos de Balance. Caixabank*

Donald Van Deventer, *Managing Director, Risk Research and Quantitative Solutions. SAS*

Moderador: Carlos Cerdá: *Responsable práctica gestión de Riesgos. SAS*