

GESTIÓN DE RIESGOS EN EL SECTOR ENERGÉTICO

GESTIÓN ESTRATÉGICA DEL RIESGO,
PARTICULARIZACIÓN PARA LA *UTILITY*
VERTICALMENTE INTEGRADA Y PARA LOS
RIESGOS DE MERCADOS FINANCIEROS

Del 29 de mayo al 25 de junio de 2023

CURSO



Club Español
de la Energía

Con la colaboración de:

Deloitte



INTRODUCCIÓN

En los últimos tiempos se ha avanzado significativamente respecto a la integración y sofisticación de los modelos y estructuras de las compañías energéticas para la gestión de riesgos. Los nuevos retos del entorno implican la necesidad de evolucionar los enfoques tradicionales de gestión de riesgos, basados en la protección del valor, hacia enfoques más proactivos orientados a la toma de decisiones estratégicas y a la creación de valor.

En este contexto, existe un interés creciente por parte de los diferentes agentes implicados en el sector de la energía: accionistas e inversores, organismos reguladores, agencias de calificación, entidades financieras y clientes finales por una gestión de los riesgos más inteligente y orientada a la creación de valor, convirtiéndose en un aspecto de importancia estratégica y de primera línea para la estabilidad y competitividad de las empresas ligadas al sector energético.

OBJETIVO

El curso tiene como objetivos estudiar, desde múltiples perspectivas, cómo está abordando el sector energético la gestión de los riesgos empresariales y dar cobertura a los aspectos fundamentales del mismo, desde un punto de vista cualitativo y cuantitativo en sus diferentes dimensiones: estratégica, organizativa, metodológica y operativa.

El curso “Gestión de Riesgos en el sector energético” está destinado a directivos, gerentes, inversores, técnicos y, en general, a profesionales de los departamentos de finanzas, aprovisionamiento, producción, distribución, comercialización y consumo de energía y a todos aquellos que, sin ser especialistas en estos temas, están interesados en poder analizar la información financiera.

El presente curso aporta como profesores a destacados profesionales del sector financiero de la industria de la energía que, con un planteamiento eminentemente práctico, aportarán su conocimiento de cómo se están adaptando las organizaciones y de los aspectos económicos que implica la correcta gestión de los riesgos en el contexto actual.

METODOLOGÍA

Este curso tendrá una duración de aproximadamente 4 semanas, con una totalidad de 40 horas, lo que supone una dedicación media del alumno de 10 horas semanales. La modalidad propuesta es la enseñanza *on line*. Cada módulo contará con clases a través de un aula virtual audio-video.

Los alumnos podrán seguir estas clases de manera síncrona o asíncrona. Así mismo trabajarán los distintos contenidos del curso haciendo uso de la plataforma *on line* que les permitirá realizar formación *e-learning*, actividades de evaluación, descargar el material audio-video, lectura de textos y comunicación e interacción con el profesor y con el resto de los alumnos a través de correo y foros.



BLOQUE I - LA GESTIÓN ESTRATÉGICA DEL RIESGO EN UNA COMPAÑÍA ENERGÉTICA: ENFOQUES CUANTITATIVOS PARA LA GESTIÓN DEL RIESGO

Webinar: 31 de mayo. 16:00h. – 18:00h.

1. Elementos clave para una gestión del riesgo enfocada a la creación de valor.
2. Los riesgos más importantes en una empresa energética: Introducción a sus características principales y principios que determinan su tratamiento en los modelos de riesgo enfocados a la cuantificación del mismo.
 - I. Riesgos de mercado (*commodities* y financieros).
 - II. Riesgos de crédito.
 - III. Riesgos operacionales.
 - IV. Riesgos de negocio y estratégicos.
3. Introducción a modelos avanzados de gestión y control integral de riesgos.
 - I. Identificación y priorización de riesgos.
 - II. Estrategia y apetito al riesgo.
 - III. Toma de decisiones basada en la optimización del binomio riesgo-retorno.
 - IV. Organización de riesgos.
4. Cultura de riesgo

Ignacio Povo
Senior Manager. Consulting - Strategy
DELOITTE

BLOQUE II - LA GESTIÓN DEL RIESGO DE LOS NEGOCIOS DE GENERACIÓN Y COMERCIALIZACIÓN DE ENERGÍA.

Webinar: 1 de junio de 16:00H. a 18:00H.

1. Principales riesgos de mercado del negocio de generación: riesgos de precio, volumen, apuntamiento, riesgos derivados de servicios de ajuste y balance del sistema, etc.
2. Principales casuísticas de riesgo asociado a tecnologías de generación: térmica convencional, hidráulica y otras renovables.
3. Principales riesgos de mercado en la comercialización de energía.
4. Estrategias de gestión del riesgo y productos disponibles.
5. Métricas y metodologías de medición de los riesgos de mercado eléctrico.
6. Elementos básicos de la infraestructura de gestión del riesgo: *front, middle* y *back office*

Ignacio Povo
Senior Manager. Consulting - Strategy
DELOITTE

BLOQUE III - RIESGOS DE MERCADOS FINANCIEROS: TIPO DE INTERÉS, TIPO DE CAMBIO Y LIQUIDEZ

Webinar: 7 de junio de 16:00h. – 18:00h.

1. Principales aspectos de los mercados de deuda y de tipo cambio.
2. Estrategias de gestión y productos disponibles.
3. Métricas y metodologías para la medición y control del riesgo financiero.
4. Principales aspectos de la contabilidad de coberturas.

José Antonio García Calderín
Senior Manager Consulting – Tecnología EIT
DELOITTE

BLOQUE IV – COBERTURAS DE TIPO DE INTERÉS, CRÉDITO Y ENERGÍA

Webinar: 8 de junio. 16:00h. – 19:00h.
21 de junio. 16:00h. – 19:00h.

1. Energía
2. Tipo de Interés
3. Préstamo francés
4. Préstamos a medida
5. Caso Práctico: Coberturas de tipo de interés

El objetivo del caso práctico será la realización de coberturas de tipo de interés sobre operaciones de financiación/inversión. Utilizando como punto de partida un préstamo francés, a lo largo del caso práctico se irán analizando las coberturas de los distintos tipos de financiación / inversión finalizando en la cobertura de operaciones irregulares.

Sergio Parra Zamorano
Added Value Products
BANCO SABADELL

Lugar de celebración

Clases en *streaming* en directo. La grabación de las sesiones se subirá al campus para su visionado por los alumnos, estaa disponibles hasta la finalización del curso. Queda prohibida la distribución y descarga de dichas grabaciones.

Club Español de la Energía. Paseo de la Castellana, 257, 1ª planta. 28046 Madrid
Telf. +34 91 323 72 21 - inscripciones@enerclub.es
www.enerclub.es

Inscripción Inscripción preferente para Socios Empresa

Nombre _____	Apellidos _____
NIF/NIE _____	Empresa _____
Cargo _____	Dpto. Dirección _____
Provincia _____	Código postal _____
CIF Empresa _____	Teléfono _____
Fax _____	e-mail _____

Cuotas de inscripción

675€ ASOCIADO EJECUTIVO
715€ SOCIO PROTECTOR
755€ EMPRESA COLABORACIÓN ESPECIAL
840€ EMPRESA ASOCIADA
840€ SOCIO INDIVIDUAL
1.095€ MATRÍCULA GENERAL

Nota: impuestos, retenciones de impuestos, tasas o cualquier gravamen serán a cargo del cliente.
Exento de I.V.A. / *Tax free*

El importe de la matrícula deberá hacerse efectivo antes de comenzar el curso e incluye la documentación.

Forma de pago

● Transferencia bancaria

Santander
c/c ES87 00490631992410250033

CAIXABANK
c/c ES50 21005398851300144472

● Pago con tarjetas: inscribese a través de nuestra web con Visa o Mastercard.

Cancelación

Cualquier cancelación deberá hacerse por escrito con al menos 48 horas hábiles antes de la celebración del curso / jornada. Las cancelaciones producidas una vez iniciado, o la no comparencia del asistente no darán lugar a ningún tipo de reembolso. El Club Español de la Energía se reserva el derecho a cancelar o modificar la fecha de realización. En estos casos sólo se realizará la devolución de la matrícula, si se hubiese efectuado, no admitiendo reclamaciones por otros gastos adicionales.

De conformidad con lo previsto en el Reglamento General de Protección de Datos europeo, el Alumno queda informado de que los datos facilitados serán tratados por ENERCLUB cuyos datos de contacto son: Paseo de la Castellana 257, planta 1ª, 28046 – Madrid, teléfono +34 913237221 y dirección de correo electrónico “atencionaterceros@enerclub.es”. Los datos personales se tratarán con el fin de prestarle los servicios de formación contratados. La base de este tratamiento es la relación contractual que vincula a ambas partes, por lo que el suministro de los datos con este fin es obligado e impediría su cumplimiento en caso contrario. El alumno tiene derecho a solicitar el acceso a sus datos personales, su rectificación o supresión, así como a la limitación de su tratamiento, a oponerse al mismo y a la portabilidad de sus datos, en los casos previstos en el Reglamento General de Protección de Datos. Frente a cualquier vulneración de sus derechos, puede usted presentar una reclamación ante la Agencia Española de Protección de Datos. En caso de que el alumno decida facilitar los datos personales de terceras personas, se compromete, bajo su exclusiva responsabilidad, a haber obtenido previamente su consentimiento para que sus datos sean tratados por ENERCLUB, debiendo haberlas informado previamente de todo lo previsto en el artículo 14 del Reglamento General de Protección de Datos. Para conocer la Política de privacidad y Condiciones Generales de Compra de Enerclub visite www.enerclub.es

AUTORIZACIÓN PARA EL USO DE IMÁGENES

1. El ALUMNO autoriza a CLUB ESPAÑOL DE LA ENERGÍA (ENERCLUB) con N.I.F. G78250263 y domicilio social en Paseo de la Castellana 257, planta 1ª, 28046 – Madrid, teléfono 913237221 y dirección de correo electrónico de contacto atencionaterceros@enerclub.es a obtener grabaciones audiovisuales e imágenes de su persona (datos identificativos: imagen/voz), con la finalidad de emitir la ponencia en tiempo real, a través de nuestro canal o de editar materiales de difusión informativa y corporativa de ENERCLUB y/o dar a conocer su actividad, y a su posterior difusión, por cualquier medio y/o soporte que ENERCLUB considere, ya sean la web de la empresa, en sus redes sociales, en prensa o en cualquier otro medio de comunicación análogo y a su incorporación en cualquier tipo de material audiovisual.

2. Dicha autorización será efectuada a favor de ENERCLUB sin limitación alguna de número, por el tiempo máximo permitido por la Ley o en su defecto de manera indefinida, con la posibilidad de de modificación y publicación o difusión de la totalidad o parte del contenido, por cualquier medio de difusión o reproducción que ENERCLUB considere, sin que por ello tenga derecho a percibir remuneración alguna. Esta autorización tiene como única salvedad y limitación aquellas utilizaciones o aplicaciones que pudieran atentar al derecho al honor en los términos previstos en la Ley Orgánica 1/85, de 5 de Mayo, de Protección Civil al Derecho al Honor, la Intimidad Personal y Familiar y a la Propia Imagen.

3. De conformidad con lo previsto en el Reglamento General de Protección de Datos europeo, los datos personales objeto del presente tratamiento serán tratados por ENERCLUB, con la finalidad indicada en el primer punto, siendo cancelados estos datos cuando dejen de ser necesarios para la finalidad para la que fueron recabados y, en todo caso, cuando el ALUMNO retire su consentimiento para el uso de los mismos. La base de este tratamiento es el consentimiento del ALUMNO. La entrega de los datos con esta finalidad es voluntaria, no pudiendo ser tratada la imagen/voz del ALUMNO para la finalidad indicada en caso de que no se faciliten.

El ALUMNO tendrá derecho a retirar su consentimiento en cualquier momento. La retirada del consentimiento no afectará a la licitud del tratamiento basada en el consentimiento previo a su retirada. En todo caso, el ALUMNO tiene derecho a solicitar el acceso a sus datos personales, su rectificación o supresión, así como, en los casos previstos en el Reglamento General de Protección de Datos, a la limitación de su tratamiento, a oponerse al mismo y a su portabilidad mediante escrito, al que se adjunte copia del DNI, dirigido a ENERCLUB, en la dirección de correo indicada en el encabezamiento. Ante cualquier eventual violación de sus derechos, puede presentar una reclamación ante la Agencia Española de Protección de Datos.

Para conocer la Política de privacidad y Condiciones Generales de Compra de Enerclub visite www.enerclub.es



GESTIÓN DE RIESGOS EN EL SECTOR ENERGÉTICO

ASOCIADOS EJECUTIVOS



Club Español
de la Energía

Con la colaboración de:

Deloitte.