



SOBRE EL PROGRAMA

El sector bancario se ha visto inmerso en una profunda reestructuración, redimensionamiento y redefinición. Estos grandes cambios han venido en gran medida de la mano de cambios normativos, regulatorios y contables.

Los riesgos bancarios han estado en el epicentro de estos cambios y han cobrado un gran protagonismo. Cuatro de los principales riesgos en este ámbito han sido objeto de cambios y revisiones por parte del regulador, especialmente en los consumos de capital.

El riesgo de mercado y Fundamental Review of the Trading Book (El riesgo de contrapartida y los ajustes de valor por riesgo de crédito (junto a otros ajustes), los impactos en las exigencias de capital en el ámbito de riesgo operacional centran el contenido de este Programa.

Los aspectos más relevantes en la medición y gestión del riesgo de balance completan la formación online que en el ámbito de riesgos se ofrece en este Programa. Las exigencias de Capital por consumo de riesgos en el ámbito bancario exigidos por Basilea II y III son abordados en detalle y de forma pragmática en los 4 bloques formativos.

DIRIGIDO A

El programa va dirigido a:

- Analistas de riesgos.
- Traders.
- Gestores de carteras y fondos.
- Auditores.
- Analistas cuantitativos.

OBJETIVOS

1. Este Programa Especialista aborda los aspectos más relevantes de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros.
2. Se abordan todos los aspectos teóricos y prácticos de los riesgos: operacional, de balance, de contrapartida y de mercado.
3. Se realiza un repaso de las principales herramientas cuantitativas necesarias para el análisis de estos riesgos.
4. Se realizarán ejemplos prácticos para la implantación de las diversas métricas habitualmente utilizadas.

METODOLOGÍA

La formación online ofrece flexibilidad y personalización del ritmo de estudio, ya que el Aula Virtual está disponible las 24 horas, incluido los fines de semana. Además, el alumno dispone de una serie de herramientas de formación que facilitan el seguimiento del curso y la consecución de los objetivos de aprendizaje:

- Unidades didácticas.
- Tests de autoevaluación, ejercicios y casos prácticos sobre los que recibirá feed back del tutor.
- Vídeos cortos de cada tema.
- Agenda de trabajo semanal.
- Tutor experto en cada uno de los temas.
- Coordinador de apoyo al alumno.

Las grabaciones de las dataconferencias estarán disponibles durante 15 días naturales. El resto del material estará accesible en el Aula Virtual durante el transcurso del programa y hasta 15 días después de la finalización del mismo. Una vez haya pasado este tiempo, el Aula Virtual se cerrará y no se podrá tener acceso a ningún tipo de documentación



A UN CLICK DE TI

Posibilidad de seguir el curso presencial a distancia.

¡Infórmese!

Este programa consiste en una formación en metodología ONLINE reforzadas con sesiones de data conferencia de cada tema. Afi Escuela de Finanzas utiliza su Aula Virtual, una herramienta de soporte online personalizada donde se encuentran todas las actividades del programa, así como el medio de comunicación entre alumnos y profesor.





TEMARIO

I. RIESGO DE CONTRAPARTE Y CVA

1. Riesgo de Contraparte:
 - a) Definición.
 - b) Normativa y regulación: Basilea III.
 - c) Valoración a mercado.
 - d) Probabilidad de default.
 - e) Exposición potencial.
 - f) Tasa de recuperación.
 - g) Modelos de riesgos potenciales.
 - h) Mecanismos de mitigación.
 - i) Definición y seguimiento de límites.
2. CVA:
 - a) Introducción: Motivación del CVA.
 - b) Normativa y regulación: Basilea III.
 - c) Definición.
 - d) Elementos que intervienen en el cálculo del CVA.
 - e) Modelos de cálculo del CVA.
 - f) Riesgo de correlación adversa.
 - g) Mecanismos de mitigación en el CVA.
 - h) Efecto portfolio. CVA marginal y CVA Incremental.
 - i) Riesgo bilateral. El DVA.
 - j) Los otros xVAs.

*El diploma se otorgará a aquellos alumnos que hayan asistido al 80% de las sesiones.

II. RIESGO DE MERCADO Y FRTB

1. Riesgo de Mercado:
 - a) Definición.
 - b) Normativa y regulación: Basilea II y III.
 - c) Medidas de sensibilidad en tipos de interés.
 - d) Medidas de sensibilidad en derivados.
 - e) Definición Value At Risk.
 - f) Cálculo de Value At Risk por método paramétrico.
 - g) Cálculo de Value At Risk por simulación histórica.
 - h) Cálculo de Value At Risk por simulación de MonteCarlo.
 - i) VaR Condicional.
 - j) VaR Marginal.
 - k) Backtesting.
 - l) Stresstesting.
 - m) Cálculo de capital por riesgos de mercado.
2. Fundamental Review of the Trading Book:
 - a) De Basilea I al FRTB: evolución en el cálculo de capital por Riesgos de Mercado.
 - b) FRTB: principales retos de la norma.
 - c) Revisión del método estándar (SBA).
 - d) Factores de riesgos modelables/no modelables.
 - e) Revisión del método avanzado (IMA).
 - f) Medidas y ratios de PL Attribution.
 - g) Cálculo del Default Risk Charge (DRC).
 - h) Back Testing y Stress Testing.

III. RIESGO DE BALANCE

1. Definición de gestión de activos y pasivos.
2. Normativa y regulación : Basilea II y III.
3. Riesgos globales de balance: tipo de interés, liquidez, cambio.
4. Riesgo de tipo de interés.
5. Riesgo de liquidez.

IV. RIESGO OPERACIONAL

1. Riesgos bancarios.
2. Marco regulatorio.
3. Cálculo de requerimientos de recursos propios.
4. Método del indicador básico.
5. Método estándar.
6. Métodos avanzados.
7. Seguros y otros mecanismos de transferencia de riesgo.
8. Clasificación de las pérdidas por riesgo operacional en función del tipo de evento.
9. Información al mercado.
10. Conclusiones.

PROFESORADO*

Luis Sala Moreno

Head of Market Risk and ALM. ABANCA

Rafael Perelló

Riesgos de Mercado, Grupo Santander

Arturo Labanda

Director Unidad de Riesgos, Banco Santander

Carlos Marín

Gestión de Balance, Banco Santander UK

Oscar García

Director de Control Interno y Riesgo Operacional Control Interno y Riesgo Operacional de Cecabank

DURACIÓN DEL PROGRAMA



Este programa tiene una duración de **96 horas totales**.
80 horas en formato online.
16 horas en sesiones de data conferencia.

FECHAS Y HORARIO



Se imparte los días:

Del 14 de abril al 26 de mayo y del 4 al 15 de octubre 2021

Horario:

Riesgo de Contraparte: **22 de abril de 11:00 a 14:00 h**

CVA : **04 de mayo de 12:00 a 14:00 h**

Riesgo de Mercado: **18 de mayo de 11:00 a 14:00 h**

FRTB: **25 de mayo de 12:00 a 14:00 h**

Riesgo de Balance: **7 de octubre de 11:00 a 14:00 h**

Riesgo Operacional: **14 de octubre de 11:00 a 14:00 h**

*Los ponentes podrían variar por causas de fuerza mayor.

**Las sesiones de data conferencia serán grabadas y podrán ser consultadas estarán accesibles en el Aula Virtual durante el transcurso del programa y hasta 15 días después de la finalización del mismo.

INVERSIÓN



El costo sería de \$ 42,500 pesos más IVA por participante.

PROCESO DE INSCRIPCIÓN

- Se formalizará la inscripción enviando un correo a **educacioncontinua@abm.org.mx** con el comprobante de pago antes del inicio del curso.
- Las cancelaciones deberán comunicarse por escrito a la dirección de correo electrónico **educacioncontinua@abm.org.mx** y darán derecho a la devolución del 100% del importe de la inscripción, siempre que se comuniquen al menos una semana antes a la fecha de inicio del curso.
- Si es miembro de la Asociación de Bancos de México consulte la promoción disponible para asociados.



educacioncontinua@abm.org.mx



afiescueladefinanzas@afi.es



+52 (55) 57 2243 92



+52 (52) 8840 9777



+52 (55) 2079 5825