

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Afi Escuela



A un clic de ti
Curso por aula
virtual
¡Infórmate!

Riesgos de Contraparte, CVA y otros ajustes XVA

Del 30 de noviembre al 2 de diciembre 2020



Afi Escuela



ASOCIACIÓN
DE BANCOS
DE MÉXICO



Riesgo de Contraparte, CVA y otros ajustes XVA

El sector bancario se ha visto inmerso en los últimos años 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.

Uno de los riesgos objeto de cambios y revisiones, incluidos los requerimientos de capital ha sido el riesgo de contraparte y CVA. En este curso se abordan los aspectos más relevantes en la medición y gestión así como las exigencias de Capital por consumo de riesgos en el ámbito bancario exigidos por Basilea II y III. La finalización de Basilea III ha tenido lugar en diciembre de 2017.

Dirigido a:

- Áreas de Riesgo de Mercado.
- Auditoría / Consultoría.
- Áreas de Validación y Desarrollo de Modelos.
- Analistas y profesionales del ámbito financiero.
- Supervisores.
- Analistas de riesgos.
- Traders.
- Gestores de carteras y de fondos.
- Analistas cuantitativos.
- Profesionales de Tesorería.





Objetivos:

1. Orientar al estudio de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros.
2. Se abordan todos los aspectos teóricos y prácticos.
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.

Temario*:

I. Riesgo de Contraparte:

1. Definición.
2. Probabilidad de default.
3. Medidas de exposición.
4. Exposición potencial futura..
5. Mecanismos de mitigación.
6. Definición y seguimiento de límites.
7. Normativa y regulación.
8. Casos Prácticos: Cálculo de exposiciones.

II. CVA y otros ajustes XVA:

1. Introducción: Motivación del CVA.
2. Definición.
3. Elementos que intervienen en el cálculo del CVA.
4. Probabilidades de "default".
5. Modelos de cálculo del CVA.
6. Riesgo de correlación adversa (WWR).
7. Efecto cartera. CVA marginal y CVA incremental, CVA allocation.
8. Riesgo bilateral. El DVA.
9. Procedimiento y arquitectura general para valoración con CVA.
10. Gestión del CVA/DVA.
11. Los otros XVAs (FVA, KVA, RVA).
12. Normativa y regulación: Basilea III.
13. Casos Prácticos: Ejemplos de cálculo de CVA y DVA. Ejemplo de cálculo de CVA allocation.

**El diploma del curso se otorgará a aquellos alumnos que hayan asistido al menos al 80% de las sesiones y realizado los ejercicios planteados en clase satisfactoriamente.*



Afi Escuela



Metodología:

Sesiones en Aula Virtual de Afi Escuela

- El curso tiene un carácter eminentemente práctico.
- Las sesiones se articularán en torno a la elaboración sistemática de ejercicios en el aula o prácticas.

Profesor*:

Giovanni Negrete

Director responsable de XVA, Santander México. DEA en Estadística por la UNED. MFC por Afi Escuela de Finanzas. MEAF por la Universidad Complutense.

**Los ponentes y clases podrían variar por causa de fuerza mayor.*

Duración del curso:

Este curso tiene una duración de 12 horas.

Fechas y horario:

Se imparte los días:

30 de noviembre // 1 y 2 de diciembre de 2020

Horario:

17:00 h. a 21:00 h.



Inversión e inscripciones:

El monto de inversión es de \$ 17,300 más IVA

- Se formalizará la inscripción enviando un correo a educacioncontinua@abm.org.mx con el comprobante de pago antes del inicio del curso.
- Si es miembro de la Asociación de Bancos de México consulte la promoción disponible para asociados en: educacioncontinua@abm.org.mx
- 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 una semana antes de la fecha de inicio del curso.

Informes:



afiescueladefinanzas@afi.es



+52 (55) 52 0735 65



+52 (55) 55 2079 5825



educacioncontinua@abm.org.mx



+52 (55) 57 2243 92





Afi Escuela



Afi Escuela



ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

www.afiescueladefinanzas.es
Av. Paseo de la Reforma 296 piso 24.
Col. Juárez 06600 CDMX
+52 (55) 52 07 3565
afiescueladefinanzas@afi.es

www.abm.org.mx
Asociación de Bancos de México, 16
de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro,
06000 CDMX
educacioncontinua@abm.org.mx

