

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Afi Escuela



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

Riesgos de Mercado y  
Requerimiento de Capital.  
FRTB

Del 7 al 10 de diciembre de 2020



Afi Escuela



ASOCIACIÓN  
DE BANCOS  
DE MÉXICO



# Riesgo de Mercado y Requerimiento de Capital. FRTB.

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, especialmente en los requerimientos de capital ha sido el riesgo de mercado. En este curso se abordan los aspectos más relevantes en la medición y gestión del Riesgo de Mercado y FRTB, 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. Abordar los aspectos más relevantes de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros, así como la nueva forma de cálculo de capital por Riesgos de Mercado en las carteras de Trading.
2. Revisa los aspectos teóricos y prácticos de los riesgos de mercado.
3. Provee un repaso de las principales herramientas cuantitativas necesarias para el análisis de los mismos.
4. Elabora ejemplos prácticos para la implantación de las diversas métricas habitualmente utilizadas en los mercados.

## Temario\*:

### I. Riesgo de Mercado:

1. Definición
2. Métricas: VaR, TailVaR, etc.
3. Metodologías de cálculo: método paramétrico, simulación histórica, simulación de Monte Carlo
4. Esquemas de aproximación: betas y delta-gamma
5. Medidas de sensibilidad en tipos de interés
6. Contribuciones al riesgo marginales y absolutas: Incremental VaR, Marginal VaR, Component VaR
7. Validación y backtesting
8. Stress testing
9. Casos Prácticos: Cálculo de métricas. Cálculo de VaR con diferentes metodologías. Cálculo de VaR mediante aproximaciones y sensibilidades. Backtesting



## Temario\*:

### II. Requerimientos de Capital por Riesgo de Mercado:

1. Revisión de los métodos actuales.
2. Nuevos requerimientos: FRTB:
  - Evolución
  - Método estándar (SBA)
  - Método avanzado (IMA)
3. Casos Prácticos: Ejemplos de cálculo de requerimientos de FRTB, método estándar para algunas clases de riesgo. Ejemplo de cálculo de Expeted Shortfall.

*\*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.*

## 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\*:

### Jorge del Valle

Socio Director en ELG, Electronic Trading Group. Profesor en Afi Escuela.

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

## Duración del curso:

Este curso tiene una duración de 16 horas.

## Fechas y horario:

Se imparten los días:

7, 8, 9 y 10 de diciembre de 2020

Horario:

17:00 h a 21:00 h.

## Inversión e inscripciones:

El monto de inversión es de \$ 23,000 más IVA

- Se formalizará la inscripción enviando un correo a [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto: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](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)
- Las cancelaciones deberán comunicarse por escrito a la dirección de correo electrónico [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto: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](mailto:afiescueladefinanzas@afi.es)



+52 (55) 52 0735 65



+52 (55) 55 2079 5825



[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)



+52 (55) 57 2243 92



Afi Escuela



Afi Escuela



ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

[www.afiescucladefinanzas.es](http://www.afiescucladefinanzas.es)  
Av. Paseo de la Reforma 296 piso 24.  
Col. Juárez 06600 CDMX  
+52 (55) 52 07 3565  
[afiescucladefinanzas@afi.es](mailto:afiescucladefinanzas@afi.es)

[www.abm.org.mx](http://www.abm.org.mx)  
Asociación de Bancos de México, 16  
de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro,  
06000 CDMX  
[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)

