



## SOBRE EL PROGRAMA

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.

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 (FRTB), el riesgo de Contraparte 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 y el riesgo de balance.

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.

Este curso es parte del Programa Especialista en Riesgos Bancarios donde se abordan los otros tres principales riesgos de este ámbito.

## DIRIGIDO A

El programa va dirigido a:

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

## OBJETIVOS

1. El curso online de Riesgos de Mercado y FRTB está orientado al estudio de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros.
2. Se abordan todos los aspectos teóricos y prácticos de los riesgos 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.

# 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 data conferencias estarán disponibles durante 15 días naturales. El resto del material estará accesibles 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 mercado y FRTB

1. Riesgos 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) Del Basilea I al FRTB.
  - 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 Change (DRC).
  - h) Back Testing y Stress Testing.

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

# PROFESORADO\*

Roberto Knop

*Director Asociado Data Analytics en Analistas Financieros Internacionales  
Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales por la UAM*

Rafael Perelló

*Riesgos de Mercado, Grupo Santander*

Arturo Labanda

*Director de Unidad de Riesgos de Mercado, Banco Santander*

## DURACIÓN DEL PROGRAMA



Este programa tiene una duración de **30 horas en formato online** y **5 horas de data conferencias**.

## FECHAS Y HORARIO



Se imparte los días:

**Del 6 al 26 mayo 2021**

Horario de data conferencias\*\*:

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

FRTB: **25 de mayo de 12:00 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 monto de inversión es de \$ **18,700** 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](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)



[afiescueladefinanzas@afi.es](mailto:afiescueladefinanzas@afi.es)



+52 (55) 57 2243 92



+52 (52) 8840 9777



+52 (55) 2079 5825