



UPSKILLING & RESKILLING EN EL
SECTOR FINANCIERO

RIESGO DE MERCADO Y BALANCE

PROGRAMA EXECUTIVE

nemesis

UNA COMPAÑÍA BESPOKE



CGRE
Club de Gestión
de Riesgos de España



ASBA
ASOCIACIÓN DE SUPERVISORES
BANCARIOS DE LAS AMÉRICAS



Nuestra Misión

Contribuyendo al fortalecimiento **de los conocimientos en el ámbito financiero y bancario**

Némesis es una **empresa líder** dedicada a la formación de profesionales en gestión de riesgos. Nos enorgullece ofrecer un entorno educativo dinámico y centrado en el estudiante, **donde la teoría se encuentra con la práctica** y la innovación impulsa el aprendizaje.

Como parte integral de nuestra visión global, hemos establecido colaboraciones estratégicas con instituciones y organizaciones internacionales líderes en la gestión de riesgos. Estos convenios no solo enriquecen su experiencia educativa sino que también les brindan la oportunidad de conectarse con perspectivas globales y prácticas innovadoras en el campo.



RIESGO DE MERCADO Y BALANCE

En un entorno financiero cada vez más complejo y volátil, **la preparación y comprensión de los riesgos de mercado, contrapartida y balance** son esenciales para cualquier profesional del sector. Los recientes eventos, como el caso **Silicon Bank Valley**, subrayan la importancia de una gestión eficaz de riesgos para garantizar la estabilidad y sostenibilidad de las instituciones financieras.

Nuestro programa de 2 meses está diseñada para proporcionarte los conocimientos y herramientas necesarios para comprender y abordar estos riesgos de manera efectiva. A lo largo del programa, exploraremos en detalle los fundamentos del riesgo de mercado y contrapartida, así como las medidas de gestión y mitigación aplicables.

Además, analizaremos los riesgos estructurales y la gestión financiera, centrándonos en el riesgo de liquidez y el riesgo de tipo de interés de balance. A través de ejemplos prácticos y casos de estudio, aprenderás a identificar y gestionar los riesgos financieros de manera proactiva, fortaleciendo así la resiliencia de tu organización frente a futuros desafíos.



Programa



8

Semanas de
especialización online



40

Horas de formación



98%

Nuestros estudiantes
trabajan a tiempo
completo, combinando
sus estudios con sus
responsabilidades
profesionales.



100%

Accede a la experiencia de
instructores líderes en la
industria que guiarán tu
camino hacia la excelencia
en gestión de riesgos.



Objetivos



Con este programa transformas tu carrera:

Al finalizar el programa tendrás:

- Un conocimiento profundo de los principios de gestión de riesgos
- Amplia Red de Contactos Profesionales
- Reconocimiento Profesional

Amplitud y Especialización

Profundizar en la comprensión de los diferentes productos financieros y mercados, abarcando tanto la amplitud de opciones como la especialización necesaria para identificar y gestionar adecuadamente los riesgos asociados a cada uno de ellos.

Cumplimiento Normativo y Basilea

Asegurar el cumplimiento estricto de las regulaciones y normativas establecidas por Basilea y otras autoridades regulatorias, mediante la implementación de procesos y controles sólidos.

Riesgos y Modelización

Herramientas y técnicas avanzadas para evaluar y modelar los riesgos de mercado, incluyendo la identificación de posibles escenarios de estrés y la estimación de pérdidas potenciales en diferentes condiciones del mercado.

Marco de gestión de riesgos ágil y flexible

Identificación proactiva de posibles escenarios extremos y la evaluación de su impacto en el balance y la exposición al riesgo de mercado.

Beneficios

El programa ha sido cuidadosamente diseñado para abordar los desafíos contemporáneos del mundo empresarial. Desde los fundamentos hasta las estrategias avanzadas, cada módulo se enfoca en proporcionar conocimientos prácticos y habilidades aplicables.

Durante este programa, nos adentraremos en los aspectos clave del riesgo de mercado y liquidez, incluyendo estrategias de mitigación y gestión proactiva para evitar escenarios adversos. Exploraremos las lecciones aprendidas de eventos pasados y las mejores prácticas utilizadas por los profesionales de riesgos financieros en todo el mundo.



Expertos a tu alcance

Nuestros profesores son expertos en sus campos y son seleccionados cuidadosamente para garantizar una enseñanza de alta calidad.



Red global

Únete a una comunidad de profesionales comprometidos que comparten conocimientos, experiencias y mejores prácticas



Actualización continua

Estamos dedicados a mantenernos al día con las últimas tendencias y regulaciones, garantizando que nuestros programas estén siempre actualizados.

Metodología



www.nemesisrisk.com

> Campus virtual

Los participantes estudian de forma individual y a su propio ritmo las lecciones magistrales impartidas por los profesores.

> Streaming

Sesiones live que incluyen casos de estudio relevantes y fomentan la participación activa de los asistentes.

> Evaluación

Podrás realizar un seguimiento de su progreso, alcance sus objetivos con la ayuda de nuestros asesores y tutores.

> Acreditación

Acreditación europea del **Club de Gestión de Riesgos de España**, la **Asociación de Supervisores Bancarios de las Américas**, con el aval de la **Federación Latinoamericana de Bancos**.

Temario

01

MÓDULO

> Riesgo de Mercado y Contrapartida

1. Productos y mercados financieros
2. Riesgo de mercado:
 - a. Historia
 - b. Definición y fundamentos del riesgo de mercado
 - c. Medición del riesgo de mercado
 - d. Los modelos de riesgo de mercado
 - e. Stress Testing
 - f. Gestión del riesgo de mercado
3. Riesgo de contrapartida
 - a. Medición del riesgo de contrapartida
 - b. Capital por riesgo de crédito
 - c. Valoración del riesgo de crédito
4. Regulación

02

MÓDULO

> Riesgo de Balance / Estructurales

1. Introducción a los riesgos estructurales y la gestión financiera.
2. El riesgo de liquidez de balance.
3. El riesgo de tipo de interés de balance.
4. Ejercicio práctico sobre el riesgo de liquidez y de interés de balance.
5. Lecciones aprendidas de una política anómala de tipo de interés y de una mala gestión de riesgos.

Programa



Ruta de aprendizaje por Módulo:

1 semana: Acceso a Campus virtual

- Contenido teórico: recursos, vídeos, lecturas recomendadas...
- Disponibilidad 24/7 desde el inicio hasta la finalización del programa

2 y 3 semana: Clase con el profesor

- Clase en tiempo real con el profesor
- Oportunidad para preguntas, casos prácticos y debates en vivo
- Material didáctico disponible para la revisión del participante

4 semana: Evaluación de la materia



RIESGO DE MERCADO Y BALANCE

	Módulo I Riesgo de Mercado y Contrapartida				Módulo II Riesgo de Balance / Estructurales			
Campus	24h/ 7d				24h/ 7d			
Clase telepresencial								
Clase telepresencial								
Evaluación								

Docentes



**Valentín
Sánchez**

**Head of Engineering Risk Control/
Director de Organización e
Ingeniería de Procesos BBVA**

MBA por la Universidad de Chicago.
Ha sido Director de Riesgos de Sistemas,
Director de Risk Technology, Director de
Valoración y Procesos de Riesgo de Mercado,
Director of Nuevos Desarrollos de Riesgos y
Responsable de Metodologías de Riesgo de
Mercado



**Alejandro
Franco**

**Senior Manager gestión de
Riesgos globales BBVA**

BBVA Ingeniería España. Estrategia y
Desarrollo de Riesgos, Finanzas, Contabilidad y
Recursos Humanos. Licenciado en ADE por la
UAM con máster en Gestión de Riesgos (BME),
Gestión de Carteras (IEB) y Bolsas y Mercados
Financieros (UAM)



Contacta con nosotros

Nemesis Formación



www.nemesisrisk.com

Estaremos encantados de ayudarte para cualquier duda o consulta.



info@nemesisrisk.com



+34 91 859 90 10