

Del 02 al 10 diciembre de 2019

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Gestión de los Riesgos de Balance (ALM)

 **Afi** Escuela

 **ABM**
ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

Gestión en Riesgos de Balance (ALM)



Introducción

El intenso proceso de transformación del sector bancario internacional del que ha resultado protagonista la estabilidad financiera (solventia, apalancamiento, liquidez y capacidad de absorción de pérdidas) y de cambios en la regulación, así como de la emergente transformación digital, exige un proceso paralelo de fortalecimiento del capital humano responsable de las alternativas de respuesta, de su planeación y seguimiento para enfrentar mejor los retos actuales.

Plenamente convencidos de la necesidad de dotar al sector bancario mexicano de nuevos conocimientos, así como de herramientas analíticas que permitan enfrentarse con éxito a este reto, Afi ha diseñado el **Diplomado en Gestión Bancaria**, que ofrece los conocimientos y entrena en las metodologías más avanzadas de análisis, planeación y control de gestión a los asistentes, a fin de generar las habilidades adecuadas para identificar las oportunidades y facilitar la toma de decisiones en el nuevo entorno. Todo ello encuadrado en el nuevo marco regulatorio tras Basilea III, y su equivalente para México.

Este curso es parte del Diplomado en Gestión Bancaria donde se abordan las otros principales gestiones dentro de este ámbito.

Objetivos

Reforzar los conocimientos de los participantes con respecto a la regulación en materia de riesgo de liquidez para las instituciones financieras mexicanas, revisar los principales elementos de la administración de activos y pasivos (ALM) para apoyar la gestión de tesorería, a través del análisis de flujos de efectivo, brechas de liquidez (o vencimiento) y planes de contingencia de liquidez; así como determinar la exposición del balance ante movimientos de la tasa de interés (brechas de depreciación).

Gestión en Riesgos de Balance (ALM)



Metodología

El curso tiene un carácter eminentemente práctico. Partiendo de los conocimientos teóricos necesarios, la práctica se articulará en torno a la elaboración sistemática de ejercicios en el aula o prácticas:

- Diagnóstico financiero de entidades de referencia, a partir de sus estados financieros y otros informes públicos.
- Valoración y modelización del riesgo de tasas de interés y de liquidez en escenarios centrales y de tensión.
- Valoración del resto de riesgos de capital: crédito, mercado, contraparte y operativo, entre otros.
- Regulación y gestión de la solvencia en el nuevo entorno regulatorio tras Basilea III, autoevaluación de capital y liquidez, planes de recuperación y resolución, exigencias de gobernanza, control interno y auditoría.
- Análisis de la aportación de valor de diferentes áreas de negocio en términos de rentabilidad ajustada al riesgo. Diseño de modelos de fijación de tasas de interés en operaciones de activo y de pasivo.
- Elaboración del mapa estratégico y cuadro de mando para validar su implantación efectiva.
- Elaboración de proyecciones financieras y de capital en un escenario central y en escenarios alternativos de tensión y valoración completa de una entidad.
- Análisis del proceso de transformación digital de un banco.

El curso podría contar adicionalmente con sesiones magistrales impartidas por consultores de Afi en las que se reflexionará sobre los principales retos económicos, financieros y sectoriales

Dirigido a

El programa va dirigido a profesionales:

- De las áreas de estudios, regulatorias, planeación financiera o estratégica, control de gestión, gestión global de balance, control de riesgos, relaciones con inversionistas, innovación y/o cambio, de los bancos y/o entidades financieras, que quieran ampliar o actualizar sus conocimientos y habilidades en gestión bancaria-financiera.
- De otras áreas de un banco y/o entidad financiera, que estén interesados en adquirir las destrezas necesarias para desarrollar su carrera profesional en las áreas de gestión, planeación y/o administración de riesgos.
- De empresas no financieras o empresas públicas que quieran profundizar en la comprensión del actual proceso de transformación del sector bancario, los conocimientos y metodologías de gestión bancaria, al tiempo que exportar las metodologías del sector bancario.



Gestión en Riesgos de Balance (ALM)



Programa

I. GESTIÓN DE LOS RIESGOS DE BALANCE (ALM)

- Introducción a la gestión del balance
- Valoración y gestión del riesgo de tasas de interés
 - Fuentes de riesgo de tasas de interés
 - Métricas para la valoración del riesgo de tasas de interés
 - Nuevas propuestas del Comité de Supervisión de Basilea
 - Operaciones de cobertura
- Cartera de valores y procesos de titulación
- Valoración y gestión del riesgo de liquidez
 - El nuevo marco de gestión y control de la liquidez en Basilea III
 - Métricas e indicadores para la valuación del riesgo de liquidez
 - El informe de autoevaluación de liquidez (ILAAP)
- Modelación del riesgo de tasas de interés y de liquidez

DIRECCIÓN ACADÉMICA Y PROFESORADO

Esteban Sánchez (Director académico – Director Programa Experto en Planificación y Control de Gestión en Banca)
Socio Director del área de Servicios Financieros-Banca
Afi: Analistas Financieros Internacionales
Ph. D. en Economía de la Empresa por la Universidad Autónoma de Madrid

José Antonio Alfaro (Director académico)
Profesor asociado de Afi Escuela de Finanzas

Blanca Elena Mireles Gavito
(Profesora de Afi Escuela de Finanzas)
Maestra en Economía por la Universidad de Cambridge, Inglaterra; Maestra en Planificación y Matemáticas Aplicadas a la Economía por el Centro de Investigación y Docencia Económicas (CIDE) y Actuarial por la Universidad Anáhuac. Experta en Administración de Riesgos y Planeación Estratégica.



Gestión en Riesgos de Balance (ALM)



DESARROLLO PROFESIONAL

Formación especializada

Beneficios para formación y desarrollo

Bolsa de Empleo

Servicio de Carreras Profesionales

NETWORKING

Eventos anuales Alumni

Jornadas Open Alumni

Eventos Sectoriales

Lead by Experiencie Journeys

DURACIÓN, FECHAS Y SEDE

Este programa consta de 16 horas de duración.

Se impartirá los días:

02, 03 , 09 y 10 de diciembre 2019

Hora: 17:00 a 21:00 hrs

• SEDE

Asociación de Bancos de México, calle 16 de Septiembre N° 27, Piso 3, Centro Histórico, Cuauhtémoc, 06000, Ciudad de México.



Gestión en Riesgos de Balance (ALM)



**El importe de la inscripción es de
\$ 22,000.00**



INSCRIPCIÓN

- 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 matrícula siempre que se comuniquen con al menos 2 semanas de antelación a la fecha de inicio del curso.

Los ponentes podrían variar por causa de fuerza mayor.



1994-2019

Afi Escuela



ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

www.afiescueladefinanzas.es
Avenida Paseo de la Reforma 296 piso
41, Col. Juárez, 06600 CDMX
+52 (55) 52 07 35 65
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

