

Del 19 al 21 de noviembre de 2019

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Riesgo de contraparte, CVA y otros ajustes XVA



Afi Escuela



ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

Riesgo de Contraparte, CVA y otros ajustes XVA



INTRODUCCIÓN

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.

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

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

El curso de Riesgo de Contraparte y CVA está orientado al estudio de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros.

Se abordan todos los aspectos teóricos y prácticos.

Se realiza un repaso de las principales herramientas cuantitativas necesarias para el análisis de estos riesgos.

Se realizarán ejemplos prácticos para la implantación de las diversas métricas habitualmente utilizadas.

Este curso de especialización en Riesgo de Contraparte y CVA se imparte por profesionales colaboradores de Afi Escuela en colaboración con la Asociación de Bancos de México.

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



Riesgo de Contraparte, CVA y otros ajustes XVA



PROGRAMA

1. Riesgo de contraparte

- a. Definición
- b. Probabilidad de default
- c. Medidas de exposición
- d. Exposición potencial futura
- e. Mecanismos de mitigación
- f. Definición y seguimiento de límites
- g. Normativa y regulación

Casos Prácticos: Cálculo de exposiciones

2. CVA y otros ajustes XVA

- a. Introducción: Motivación del CVA
- b. Definición
- c. Elementos que intervienen en el cálculo del CVA
- d. Probabilidades de “default”
- e. Modelos de cálculo del CVA
- f. Riesgo de correlación adversa (WWR)
- g. Efecto cartera. CVA marginal y CVA incremental, CVA allocation
- h. Riesgo bilateral. El DVA.
- i. Procedimiento y arquitectura general para valoración con CVA
- j. Gestión del CVA/DVA
- k. Los otros XVAs (FVA, KVA, RVA)
- l. Normativa y regulación: Basilea III

Casos Prácticos: Ejemplos de cálculo de CVA y DVA. Ejemplo de cálculo de CVA allocation.

DIRECCIÓN ACADÉMICA Y PROFESORADO

Pilar Barrios

Socia/Partner – Afi
Doctora en CC. Matemáticas por la UC3M
MFC por Afi Escuela de Finanzas

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.

Riesgo de Contraparte, CVA y otros ajustes XVA



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

Con una duración total de 12 horas.

Del 19 al 21 de noviembre 2019
de 17:00 a 21:00 horas

* SEDE

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

Riesgo de Contraparte, CVA y otros ajustes XVA



El importe de la inscripción es de:

\$ 16,500.00



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 inscripción siempre que se comuniquen con al menos una semana de antes a la fecha de inicio del curso.

Los ponentes podrían variar por causa de fuerza mayor.



www.afiescueladefinanzas.es
Avenida Paseo de la Reforma 296 piso
41, Col. Juárez, 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