

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Afi Escuela

online

Especialista en Riesgo
de Balance

Del 2 al 8 de octubre 2020



Afi Escuela



ASOCIACIÓN
DE BANCOS
DE MÉXICO

Especialista en Riesgo de Balance



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 Balance, 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 profesionales:

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



Especialista en Riesgo de Balance



Objetivos:

1. El curso online de Riesgos de Balance 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 Balance.
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 habitualmente utilizadas.

Temario*:

- I. Riesgo de balance:
 1. Definición de gestión de activos y pasivos.
 2. Normativa y regulación: Basilea II y III.
 3. Riesgos globales de balance: tipo de interés, liquidez y cambio
 4. Riesgo de tipo de interés:
 - Análisis del gap de sensibilidad.
 - Análisis del gap de duración.
 - Modelos de simulación.
 - Uso de los derivados en la gestión del gap de sensibilidad.
 5. Riesgo de liquidez:
 - Gestión del riesgo de liquidez.
 - Definición de escenarios.
 - Plan de contingencia.
 - Gap de liquidez.
 - Coeficiente de liquidez.
 - Horizonte de supervivencia.
 - Ratios de Liquidez de Basilea.

** El diploma se otorgará a aquellos alumnos que hayan asistido, al 80% de las sesiones y realizado los ejercicios planteados en clase satisfactoriamente.*

Especialista en Riesgo de Balance



Metodología:

Sesiones online

- El curso se realiza por Aula Virtual, una herramienta de soporte online personalizada con las actividades del programa y como medio de comunicación entre alumno y profesor.
- Reforzado con sesiones de data conferencia de cada tema.

Profesor*:

Roberto Knop

Presidente de Jones LangLasalle Valoraciones. Asesor externo de COFIDES. Miembro del Consejo Académico de Afi Escuela de Finanzas S.A. Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales en "Banca y Bolsa" en la Universidad Autónoma de Madrid. Profesor de Afi Escuela.

Carlos Marin

Gestión de Balance, Banco Santander UK. Profesor de Afi Escuela.

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

Duración y Fechas:

Este programa tiene una duración de 13 horas.

10 horas en formato online: 2 al 8 de octubre de 2020.

3 horas en una sesión de data conferencia:

- Riesgo de Balance: 6 de octubre de 11:00 a 13:00 h.

Especialista en Riesgo de Balance

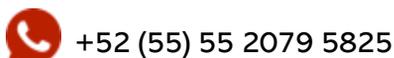
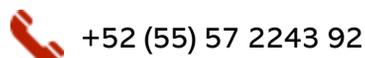
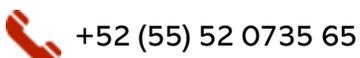


Inversión e inscripciones:

El monto de inversión es de \$ 8,200 más IVA.

- 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 una semana antes de la fecha de inicio del curso.

Informes:



Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Afi Escuela



Afi Escuela



ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

www.afiescueladefinanzas.es
Av. Paseo de la Reforma 296 piso 24.
Col. Juárez 06600 CDMX
+52 (55) 52 07 3565
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

