

27 y 28 de nov 02 y 03 de dic 2019

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Riesgos Estructurales y de Liquidez

Requerimientos regulatorios y su integración en la gestión.

Riesgos Estructurales y de Liquidez: Requerimientos regulatorios y su integración en la gestión.



INTRODUCCIÓN

La gestión de los Riesgos Estructurales se basa en las técnicas y procedimientos que permiten llevar a cabo el proceso de gestión estratégica de los activos y pasivos en una Entidad en su conjunto. Busca alcanzar los objetivos financieros propuestos dado un nivel de tolerancia/apetito al riesgo y las limitaciones del mercado (rating, liquidez, acceso al mercado, divisas,...)

En los últimos años, los Riesgos Estructurales han supuesto un importante foco en la gestión de los riesgos globales de las entidades financieras.

Restricciones de liquidez, contexto de tipos de interés inusualmente bajos y requerimientos regulatorios han marcado la gestión de las entidades, convirtiéndose en un aspecto clave en cualquier entidad financiera.

OBJETIVOS

Este curso tiene como objetivo conocer los riesgos estructurales, los actuales requerimientos regulatorios y la gestión de los mismos en las entidades financieras con un enfoque inminentemente práctico para su mejor comprensión y aplicación.

DIRIGIDO A

- Áreas de Riesgo Estructurales
- Auditoría / Consultoría
- Áreas de Back-Office
- Áreas de Validación y Desarrollo de Modelos
- Analistas y profesionales del ámbito financiero
- Supervisores
- Profesionales de gestión de activos y pasivos
- Control de gestión y planificación financiera
- Agencias de rating
- Profesionales de Tesorería

Riesgos Estructurales y de Liquidez: Requerimientos regulatorios y su integración en la gestión.



PROGRAMA

1. Definición y alcance de los Riesgos Estructurales

2. Riesgo de liquidez

- a. Definición e importancia del riesgo de liquidez
- b. Fuentes de financiación
- c. Medición del riesgo
 - i. Gap de liquidez
 - ii. Ratios e indicadores de liquidez.
 - iii. Buffer de liquidez y tasas de transferencia.
 - iv. Escenarios de estrés
- d. Liquidez intradía
- e. Regulación
 - i. Requerimientos
 - ii. Reportes y ratios regulatorios: LCR, NSFR, Asset Encumbrance, Additional Monitoring Metrics
 - iii. ILAAP
- f. Gobierno, control y seguimiento

Caso Práctico 1: Cálculo de métricas y ratios

Caso Práctico 2: Gestión de ratios y exigencias regulatorias

3. Riesgo de interés

- a. Definición e importancia del riesgo de interés
- b. Medición del riesgo
 - i. Gap de reprecio
 - ii. NIM, Duración y EVE
 - iii. Escenarios de estrés
- c. Modelos comportamentales: tratamiento de activos y pasivos sin vencimiento.
- d. Curvas y estimación del Margen Financiero
- e. Regulación
- f. Gobierno, control y seguimiento

Caso Práctico 1: Cálculo de principales métricas

Caso Práctico 2: Gestión de Margen

4. Riesgo de tipo de cambio

- a. Definición e importancia del Riesgo de cambio
- b. Impacto en la gestión de los riesgos Estructurales
- c. Gestión estructural del riesgo de tipo de cambio: coberturas

Riesgos Estructurales y de Liquidez: Requerimientos regulatorios y su integración en la gestión.



METODOLOGÍA

El Programa se imparte por profesionales de Afi Escuela y la Asociación de Bancos de México.

La metodología de trabajo es PRESENCIAL y eminentemente práctica. Las exposiciones teóricas se complementarán con la realización de ejercicios, ejemplos y análisis de casos prácticos, con el doble objetivo de permitir a los asistentes la puesta en marcha de los conceptos aprendidos a lo largo del programa y facilitar su participación y el compartir de sus experiencias con los ponentes y el resto de los asistentes.

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 16 horas.

**Fechas: 27 y 28 de noviembre, 02 y 03
de diciembre de 2019**

Horario: 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.

DIRECCIÓN ACADÉMICA Y PROFESORADO

Pilar Barrios (Dirección)

Socia/Partner, Afi Analistas Financieros Internacionales

Doctora en CC Matemáticas por la UC3M
MFC por Afi Escuela de Finanzas



Riesgos Estructurales y de Liquidez: Requerimientos regulatorios y su integración en la gestión



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 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