

Del 28 de mayo al 03 de junio de 2019

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



## Curso de Especialización en Riesgos de Balance

online



# Curso de Especialización en Riesgos de Balance



## 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.

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.

## OBJETIVOS

- El curso online de Riesgos de Balance está orientado al estudio de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros.
- Se abordan todos los aspectos teóricos y prácticos de los riesgos de Balance
- 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.

## DIRIGIDO A

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

# Curso de Especialización en Riesgos de Balance



## METODOLOGÍA

Este programa combina formación ONLINE reforzada con una sesión de data conferencia. Afi Escuela de Finanzas utiliza su Aula Virtual, una herramienta de soporte online personalizada donde se encuentran todas las actividades del programa, así como el medio de comunicación entre alumnos y profesor.

La formación online ofrece flexibilidad y personalización del ritmo de estudio, ya que el Aula Virtual está disponible las 24 horas, incluido los fines de semana. Además, el alumno dispone de una serie de herramientas de formación que facilitan el seguimiento del curso y la consecución de los objetivos de aprendizaje:

- Tests de autoevaluación, ejercicios y casos prácticos sobre los que recibirá feed-back del tutor.
- Unidades didácticas.
- Agenda de trabajo semanal.
- Tutor experto en cada uno de los temas.
- Coordinador de apoyo al alumno.

## DIRECCIÓN ACADÉMICA Y PROFESORADO

### Roberto Knop

Presidente de Jones Lang Lasalle Valoraciones  
Asesor externo de COFIDES. Miembro del Consejo Académico de Afi Escuela de Finanzas S.A.

### Carlos Marin

Gestión de Balance, Banco Santander UK

## PROGRAMA

### RIESGOS DE BALANCE

- Definición de gestión de activos y pasivos
- Normativa y regulación: Basilea II y III
- Riesgos globales de balance: tipo de interés, liquidez, cambio
- 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
- 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

## TITULACIÓN

El seguimiento de este curso no conduce a la obtención de un título con validez oficial. Afi Escuela de Finanzas emitirá un certificado de realización del curso siempre que el alumno haya superado al menos el 80% de las actividades programadas a lo largo del mismo.



## Curso de Especialización en Riesgos de Balance



### DURACIÓN, FECHAS Y SEDE

Este programa consta de 13 horas de duración:

**10 horas en formato online: del 28 de mayo al 03 de junio de 2019.**

**3 horas en una sesión de data conferencia el 03 de junio de 2019 de 11:00 a 14:00 horas.**

La sesión de data conferencia se seguirá a distancia, pudiendo transmitir vídeo y audio en tiempo real. Esta sesión a distancia también se podrá seguir desde las aulas de la Asociación de Bancos de México, 16 de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro, 06000 CDMX.

### AFI Alumni

Después de 24 años de actividad, Afi Escuela ha formado una amplia comunidad de profesionales en el ámbito económico-financiero-tecnológico. Afi Alumni es un servicio destinado al antiguo alumno que ofrece los siguientes beneficios:

- Crear una Comunidad de Antiguos Alumnos para facilitar y promover las relaciones profesionales y sociales entre los antiguos alumnos.
- Contribuir al desarrollo profesional de sus miembros mediante actividades de formación y orientación profesional.
- Facilitar contenido e informes sectoriales elaborados por el Grupo Afi y envío periódico de la Revista especializada del grupo.
- Fomentar la relación de los antiguos alumnos con Afi Escuela y el grupo Afi, creando una red de conocimiento en temas económico-financieros-tecnológicos.



## Curso de Especialización en Riesgos de Balance



El importe de la inscripción es de  
**\$7,800.00**



## INSCRIPCIÓN

- Se formalizará la inscripción enviando un correo a [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto: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](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)
- Las cancelaciones deberán comunicarse por escrito a la dirección de correo electrónico [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto: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](http://www.afiescueladefinanzas.es)  
Avenida Paseo de la Reforma 373  
piso 9B, Col. Cuauhtémoc, CDMX,  
México  
+52 (55) 52 07 35 65  
[afiescueladefinanzas@afi.es](mailto:afiescueladefinanzas@afi.es)



[www.abm.org.mx](http://www.abm.org.mx)  
Asociación de Bancos de México,  
16 de Septiembre 27, Piso 3,  
Col. Centro, 06000 CDMX  
5722 4300  
[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)