

Del 06 al 27 de mayo de 2019

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Curso de Especialización en Riesgo de Mercado y FRTB

online



Curso de Especialización en Riesgos de Mercado y FRTB



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 Mercado y FRTB, 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 Mercado y FRTB 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 Mercado
- 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 Mercado y FRTB



METODOLOGÍA

Este programa combina formación ONLINE reforzada con dos sesiones 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.

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.

PROGRAMA

RIESGOS DE MERCADO

- Definición
- Normativa y regulación: Basilea II y III
- Medidas de sensibilidad en tipos de interés
- Medidas de sensibilidad en derivados
- Definición Value At Risk
- Cálculo de Value At Risk por método paramétrico
- Cálculo de Value At Risk por simulación histórica
- Cálculo de Value At Risk por simulación de MonteCarlo
- VaR Condicional
- VaR Marginal
- Backtesting
- Stresstesting
- Cálculo de capital por riesgos de mercado

FUNDAMENTAL REVIEW OF THE TRADING BOOK

- Del Basilea I al FRTB
- FRTB: principales retos de la norma
- Revisión del método estándar (SBA)
- Factores de riesgos modelables/no modelables
- Revisión del método avanzado (IMA)
- Medidas y ratios de PL Attribution
- Cálculo del Default Risk Change (DRC)
- Back Testing y Stress Testing

Curso de Especialización en Riesgos de Mercado y FRTB



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.

Rafael Perelló

Riesgos de Mercado, Grupo Santander

Arturo Labanda

Director de Unidad de Riesgos de Mercado, Banco Santander

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.

DURACIÓN, FECHAS Y SEDE

Este programa consta de 35 horas de duración.

30 horas en formato online: del 06 al 27 de mayo de 2019.

5 horas de data conferencia distribuidas en:

- **Riesgo de Mercado: 17 de mayo de 2019 en horario de 11:00h a 14:00 horas.**

- **FRTB: 24 de mayo de 2019 en horario de 12:00h a 14:00 horas.**

La sesión presencial 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.

Curso de Especialización en Riesgos de Mercado y FRTB



El importe de la inscripción es de
\$ 13,900.00



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 373
piso 9B, Col. Cuauhtémoc, CDMX,
México
+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
5722 4300
educacioncontinua@abm.org.mx