

Del 25 al 28 de Marzo 2019

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Riesgo de Mercado y requerimientos de capital, FRTB



Afi Escuela

ABM
ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

Riesgo de Mercado y requerimientos de capital, 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.

Uno de los riesgos objeto de cambios y revisiones, especialmente en los requerimientos de capital ha sido el riesgo de mercado. 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. La finalización de Basilea III ha tenido lugar en diciembre de 2017.

Este curso es parte del Diplomado en Gestión de Riesgos Financieros donde se abordan los otros 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 mercado y FRTB aborda los aspectos más relevantes de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros, así como la nueva forma de cálculo de capital por Riesgos de Mercado en las carteras de Trading.

Revisa los aspectos teóricos y prácticos de los riesgos de mercado.

Provee un repaso de las principales herramientas cuantitativas necesarias para el análisis de los mismos.

Elabora ejemplos prácticos para la implantación de las diversas métricas habitualmente utilizadas en los mercados.

Riesgo de Mercado y requerimientos de capital, FRTB



PROGRAMA

1. Riesgo de mercado

- a. Definición
- b. Métricas: VaR, TailVaR, etc.
- c. Metodologías de cálculo: método paramétrico, simulación histórica, simulación de Monte Carlo
- d. Esquemas de aproximación: betas y delta-gamma
- e. Medidas de sensibilidad en tipos de interés
- f. Contribuciones al riesgo marginales y absolutas: Incremental VaR, Marginal VaR, Component VaR
- g. Validación y backtesting
- h. Stress testing

Casos Prácticos: Cálculo de métricas. Cálculo de VaR con diferentes metodologías. Cálculo de VaR mediante aproximaciones y sensibilidades. Backtesting

2. Requerimientos de capital por riesgo de mercado

- a. Revisión de los métodos actuales
- b. Nuevos requerimientos: FRTB
 - i. Evolución
 - ii. Método estándar (SBA)
 - iii. Método avanzado (IMA)

Casos Prácticos: Ejemplos de cálculo de requerimientos de FRTB, método estándar para algunas clases de riesgo. Ejemplo de cálculo de Expeted Shortfall.

DURACIÓN, FECHAS Y SEDE

Con una duración total de 16 horas.

* SEDE

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

Del 25 al 28 de marzo 2019

de 17:00 a 21:00 horas

DIRECCIÓN ACADÉMICA Y PROFESORADO

Pilar Barrios

Socia/Partner – Afi

Doctora en CC. Matemáticas por la UC3M

MFC por Afi Escuela de Finanzas

Riesgo de Mercado y requerimientos de capital, FRTB



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.

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 Experience Journeys

Riesgo de Mercado y requerimientos de capital, FRTB



**El importe de la inscripción es de
\$ 25,500.00**



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.



Afi Escuela

www.afiescueladefinanzas.es
Avenida Paseo de la Reforma 373 piso
9B, Col. Cuauhtémoc, CDMX, México
+52 (55) 52 07 35 65
afiescueladefinanzas@afi.es



ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

www.abm.org.mx
Asociación de Bancos de México, 16
de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro,
06000 CDMX, México
educacioncontinua@abm.org.mx