

Formación en  
FINANZAS y TECNOLOGÍA



Programa Especialista  
en  
**RIESGOS  
BANCARIOS**

**Octubre – Diciembre 2017**



# Programa Especialista en RIESGOS BANCARIOS



Octubre – Diciembre 2017

## 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 contrapartida 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 centran el contenido de este Programa Especialista online que Afi Escuela vuelve a lanzar con contenidos actualizados y cobertura internacional, en colaboración con la Asociación de Bancos de México. Los aspectos más relevantes en la medición y gestión del riesgo de balance completan la formación online que en el ámbito de riesgos se ofrece en este Programa. Las exigencias de Capital por consumo de riesgos en el ámbito bancario exigidos por Basilea II y III son abordados en detalle y de forma pragmática en los 4 bloques formativos.

## OBJETIVO

- Este Programa Especialista aborda los aspectos más relevantes de los riesgos inherentes a la actividad en los mercados financieros.
- Se abordan todos los aspectos teóricos y prácticos de los riesgos: operacional, de balance, de contrapartida y 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

## METODOLOGÍA

El programa especialista en **Riesgos Bancarios** se imparte por profesionales de Afi Escuela en colaboración con la Asociación de Bancos de México en México.

Este programa combina una formación ONLINE complementada con sesiones presenciales a distancia (en tiempo real) en las que se asientan conceptos a la vez que se ponen en práctica. La formación online ofrece flexibilidad y personalización del ritmo de estudio, ya que el Campus Virtual está disponible las 24 horas, incluido los fines de semana.

El alumno dispone de una serie de herramientas de formación que facilitan el seguimiento del curso y la consecución de los objetivos de aprendizaje:

- Test de autoevaluación, ejercicios, casos prácticos a través de los que el alumno puede poner en práctica lo aprendido y sobre lo que recibirá feedback del tutor
- Unidades didácticas en las que se cubren de forma amena, los contenidos teóricos, de manera que se facilita el estudio por parte del alumno
- Agenda de trabajo semanal, que ayuda al alumno a planificar su tiempo de estudio
- Tutor experto en cada uno de los temas para resolver dudas, y que propondrá actividades complementarias durante el desarrollo del curso
- Coordinador que dará apoyo al alumno en todo lo referente al funcionamiento de la plataforma online, documentación, etc.

# Programa Especialista en RIESGOS BANCARIOS



Octubre – Diciembre 2017

## PROGRAMA

### INTRODUCCIÓN A RIESGOS BANCARIOS

#### I. RIESGO DE CONTRAPARTIDA Y CVA

##### 1. Riesgo de Contrapartida

- Definición
- Normativa y regulación: Basilea III
- Valoración a mercado
- Probabilidad de default
- Exposición potencial
- Tasa de recuperación
- Modelos de riesgos potenciales
- Mecanismos de mitigación
- Definición y seguimiento de límites

#### II. RIESGO DE MERCADO Y FRTB

##### 1. Riesgo 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

#### III. RIESGO 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
- Riesgo de liquidez

##### 2. CVA

- Introducción: Motivación del CVA
- Normativa y regulación: Basilea III
- Definición
- Elementos que intervienen en el cálculo del CVA
- Modelos de cálculo del CVA
- Riesgo de correlación adversa
- Mecanismos de mitigación en el CVA
- Efecto portfolio. CVA marginal y CVA incremental
- Riesgo bilateral. El DVA.
- Los otros xVAs

##### 2. Fundamental Review of the Trading Book

- De Basilea I al FRTB: evolución en el cálculo de capital por Riesgos de Mercado
- 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 Charge (DRC)
- Back Testing y Stress Testing

#### IV. RIESGO OPERACIONAL

- Riesgos bancarios
- Marco regulatorio
- Cálculo de requerimientos de recursos propios
- Método del indicador básico
- Método estándar
- Métodos avanzados
- Seguros y otros mecanismos de transferencia de riesgo
- Clasificación de las pérdidas por riesgo operacional en función del tipo de evento
- Información al mercado
- Conclusiones

El Programa Especialista en Riesgos Bancarios otorga 400 puntos AMIB para revalidar la certificación en Fondos de Inversión y Mercado de Valores.

## 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.

Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales en "Banca y Bolsa" en la Universidad Autónoma de Madrid.



# Programa Especialista en RIESGOS BANCARIOS



## DURACIÓN, FECHAS y LUGAR

Octubre – Diciembre 2017

- Duración de 96 horas.
  - 80 horas en formato online: del 6 de octubre al 8 de diciembre 2017
  - 16 horas de sesiones presenciales (en sábados, dentro del horario de 9:00 a 14:00 hrs.).
    - Riesgo de Contrapartida y CVA: 28 de octubre de 2017
    - Riesgo de Mercado y FRTB: 25 de noviembre de 2017
    - Riesgo de Balance: 2 de diciembre 2017
    - Riesgo Operacional: 9 de diciembre de 2017

- Existe la posibilidad de inscribirse individualmente en los Cursos de Especialización que lo forman:

Curso de Especialización en	Fechas	Horas	Horas	Precio
		ONLINE	PRESENCIALES	
Riesgo de Contrapartida y CVA	6 al 28 de Octubre de 2017	30	5	\$13,900.00
Riesgo de Mercado y FRTB	3 al 25 Noviembre de 2017	30	5	\$13,900.00
Riesgo de Balance	27 de Noviembre al 2 de Diciembre de 2017	10	3	\$7,800.00
Riesgo Operacional	4 al 9 de Diciembre de 2017	10	3	\$7,800.00
<b>Programa Especialista en Riesgos Bancarios</b>	<b>6 de Octubre al 9 de Diciembre 2017</b>	<b>80</b>	<b>16</b>	<b>\$39,900.00</b>

- Las **sesiones presenciales se seguirán a distancia**, pudiendo transmitir vídeo y audio en tiempo real. Estas sesiones a distancia también se podrán seguir desde las aulas de la Asociación de Bancos de México, 16 de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro, 06000 CDMX, México

## INSCRIPCIONES y ADMISIÓN

- El importe de la inscripción es de \$39,900.00 (no incluye IVA)
- Para solicitar su inscripción al programa, el candidato deberá enviar un correo electrónico manifestando su interés a la dirección: [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx).
- Hay plazas limitadas. Una vez recibido la solicitud de inscripción, se formalizará la inscripción (sujeta a disponibilidad) enviando un correo electrónico de confirmación a la dirección de email que figure en la solicitud e iniciando los trámites de facturación. Antes del comienzo del curso deberá enviarse copia de la transferencia bancaria o de la forma de pago realizada, confirmando el abono del importe de la matrícula.
- 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 matrícula siempre que se comuniquen con al menos 2 semanas de antelación a la fecha de inicio del curso.



Afi Escuela

ABM  
ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

[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, México  
5722 4300  
[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)



Formación en  
FINANZAS y TECNOLOGÍA



**Curso  
de Especialización en  
RIESGO DE  
CONTRAPARTIDA Y  
CVA**

**Octubre 2017**



# Curso de Especialización en RIESGO DE CONTRAPARTIDA Y CVA



Octubre 2017

## 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 contrapartida 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 Contrapartida y CVA**, 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.

## OBJETIVO

El curso online de **Riesgos de Contrapartida y CVA** 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 contrapartida y cálculo del CVA.
- 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

## METODOLOGÍA

Este curso de especialización en **Riesgos de Contrapartida y CVA** se imparte por profesionales de Afi Escuela en colaboración con la Asociación de Bancos de México en México.

Este programa combina una formación ONLINE complementada con una sesión presencial en el que se asientan conceptos a la vez que se ponen en práctica. La formación online ofrece flexibilidad y personalización del ritmo de estudio, ya que el Campus Virtual está disponible las 24 horas, incluido los fines de semana.

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, casos prácticos a través de los que el alumno puede poner en práctica lo aprendido y sobre lo que recibirá feed-back del tutor
- Unidades didácticas en las que se cubren de forma amena los contenidos teóricos, de manera que se facilita el estudio por parte del alumno
- Agenda de trabajo semanal, que ayuda al alumno a planificar su tiempo de estudio
- Tutor experto en cada uno de los temas para resolver dudas, y que propondrá actividades complementarias durante el desarrollo del curso
- Coordinador que dará apoyo al alumno en todo lo referente al funcionamiento de la plataforma online, documentación, etc.

# Curso de Especialización en RIESGO DE CONTRAPARTIDA Y CVA



## PROGRAMA

Octubre 2017

### 1. RIESGOS DE CONTRAPARTIDA

- Definición
- Normativa y Regulación
- Valoración a mercado
- Probabilidad de default
- Exposición potencial
- Tasa de recuperación
- Modelos de riesgos potenciales
- Mecanismos de mitigación
- Definición y seguimiento de límites

### 2. CVA

- Introducción: Motivación del CVA
- Normativa y regulación: Basilea III
- Definición
- Elementos que intervienen en el cálculo del CVA
- Modelos de cálculo del CVA
- Riesgo de correlación adversa
- Mecanismos de mitigación en el CVA
- Efecto portfolio. CVA marginal y CVA incremental
- Riesgo bilateral. El DVA.
- Los otros xVAs

El curso otorga 100 puntos AMIB para revalidar la certificación en Fondos de Inversión y Mercado de Valores.

## 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.

Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales en "Banca y Bolsa" en la Universidad Autónoma de Madrid.

### Luis Sala

Riesgo de mercado, liquidez e interés, ABANCA

### Giovanni Negrete

ED Responsable de xVA Desk

Santander Global Banking México

## DURACIÓN, FECHAS Y LUGAR

- Este programa consta de 35 horas de duración.
  - 30 horas en formato online: del 6 al 27 de octubre de 2017.
  - 5 horas en una sesión presencial: 28 de octubre de 2017 en horario de 9:00h a 14:00 hrs.
- Se impartirá en la Asociación de Bancos de México, 16 de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro, 06000 CDMX, México

## INSCRIPCIONES y ADMISIÓN

- El importe de la inscripción es de \$13,900.00 (no incluye IVA)
- Para solicitar su inscripción al programa, el candidato deberá enviar un correo electrónico manifestando su interés a la dirección: [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx).
- Hay plazas limitadas. Una vez recibido la solicitud de inscripción, se formalizará la inscripción (sujeta a disponibilidad) enviando un correo electrónico de confirmación a la dirección de email que figure en la solicitud e iniciando los trámites de facturación. Antes del comienzo del curso deberá enviarse copia de la transferencia bancaria o de la forma de pago realizada, confirmando el abono del importe de la matrícula.
- 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 matrícula siempre que se comuniquen con al menos 2 semanas de antelación a la fecha de inicio del curso.



[www.afiescueladefinanzas.es](http://www.afiescueladefinanzas.es)  
Avenida Paseo de la Reforma 373 piso  
9B, Col. Cuauhtémoc, 06500, 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, México  
5722 4300  
[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)





Formación en  
FINANZAS y TECNOLOGÍA



**Curso  
de Especialización en  
RIESGO DE  
MERCADO Y FRTB**

**Noviembre 2017**



# Curso de Especialización en RIESGO DE MERCADO Y FRTB



## INTRODUCCIÓN

Noviembre 2017

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 contrapartida 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 **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.

## DIRIGIDO A

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

## METODOLOGÍA

Este curso de especialización en **Riesgo de Mercado y FRTB** se imparte por profesionales de Afi Escuela en colaboración con la Asociación de Bancos de México en México.

Este programa combina una formación ONLINE complementada con una sesión presencial en el que se asientan conceptos a la vez que se ponen en práctica. La formación online ofrece flexibilidad y personalización del ritmo de estudio, ya que el Campus Virtual está disponible las 24 horas, incluido los fines de semana.

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, casos prácticos a través de los que el alumno puede poner en práctica lo aprendido y sobre lo que recibirá feed-back del tutor
- Unidades didácticas en las que se cubren de forma amena los contenidos teóricos, de manera que se facilita el estudio por parte del alumno
- Agenda de trabajo semanal, que ayuda al alumno a planificar su tiempo de estudio
- Tutor experto en cada uno de los temas para resolver dudas, y que propondrá actividades complementarias durante el desarrollo del curso
- Coordinador que dará apoyo al alumno en todo lo referente al funcionamiento de la plataforma online, documentación, etc.

# Curso de Especialización en RIESGO DE MERCADO Y FRTB



## PROGRAMA

Noviembre 2017

1. 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
2. FUNDAMENTAL REVIEW OF THE TRADING BOOK
  - De Basilea I al FRTB: evolución en el cálculo de capital por Riesgos de Mercado
  - 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 Charge (DRC)
  - Back Testing y Stress Testing

El curso otorga 100 puntos AMIB para revalidar la certificación en Fondos de Inversión y Mercado de Valores

## 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.

Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales en "Banca y Bolsa" en la Universidad Autónoma de Madrid.

### Rafael Perelló

Riesgos de Mercado,

Grupo Santander

### Arturo Labanda

Director de Unidad de Riesgos de Mercado,

Banco Santander

## DURACIÓN, FECHAS Y LUGAR

- Este programa consta de 35 horas de duración.
  - 30 horas en formato online: del 3 al 24 de noviembre de 2017.
  - 5 horas en una sesión presencial: 25 de noviembre de 2017 en horario de 9:00 a 14:00 hrs.
- Se impartirá en la Asociación de Bancos de México, 16 de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro, 06000 CDMX, México

## INSCRIPCIONES y ADMISIÓN

- El importe de la inscripción es de \$13,900.00 (no incluye IVA)
- Para solicitar su inscripción al programa, el candidato deberá enviar un correo electrónico manifestando su interés a la dirección: [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx).
- Hay plazas limitadas. Una vez recibido la solicitud de inscripción, se formalizará la inscripción (sujeta a disponibilidad) enviando un correo electrónico de confirmación a la dirección de email que figure en la solicitud e iniciando los trámites de facturación. Antes del comienzo del curso deberá enviarse copia de la transferencia bancaria o de la forma de pago realizada, confirmando el abono del importe de la matrícula.
- 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 matrícula siempre que se comuniquen con al menos 2 semanas de antelación a la fecha de inicio del curso.



[www.afiescueladefinanzas.es](http://www.afiescueladefinanzas.es)  
Avenida Paseo de la Reforma 373 piso  
9B, Col. Cuauhtémoc, 06500, 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, México  
5722 4300  
[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)



Formación en  
FINANZAS y TECNOLOGÍA



Curso  
de Especialización  
en  
**RIESGO DE BALANCE**

**Noviembre - Diciembre 2017**



**Afi** Escuela



ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO

# Curso de Especialización en RIESGO DE BALANCE



Noviembre - Diciembre 2017

## 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 contrapartida 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 **Riesgo de balance** aborda los aspectos más relevantes 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

## METODOLOGÍA

Este curso de especialización en **Riesgo de Balance** se imparte por profesionales de Afi Escuela en colaboración con la Asociación de Bancos de México en México.

Este programa combina una formación ONLINE complementada con una sesión presencial en el que se asientan conceptos a la vez que se ponen en práctica. La formación online ofrece flexibilidad y personalización del ritmo de estudio, ya que el Campus Virtual está disponible las 24 horas, incluido los fines de semana.

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, casos prácticos a través de los que el alumno puede poner en práctica lo aprendido y sobre lo que recibirá feed-back del tutor
- Unidades didácticas en las que se cubren de forma amena, los contenidos teóricos, de manera que se facilita el estudio por parte del alumno
- Agenda de trabajo semanal, que ayuda al alumno a planificar su tiempo de estudio
- Tutor experto en cada uno de los temas para resolver dudas, y que propondrá actividades complementarias durante el desarrollo del curso
- Coordinador que dará apoyo al alumno en todo lo referente al funcionamiento de la plataforma online, documentación, etc.

# Curso de Especialización en RIESGO DE BALANCE



Noviembre - Diciembre 2017

## PROGRAMA

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, 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 curso otorga 100 puntos AMIB para revalidar la certificación en Fondos de Inversión y Mercado de Valores.

## 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.

Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales en "Banca y Bolsa" en la Universidad Autónoma de Madrid.

### Carlos Marín

Gestión de Balance, Banco Santander UK

## DURACIÓN, FECHAS Y LUGAR

- Este programa consta de 13 horas de duración.
  - 10 horas en formato online: del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2017.
  - 3 horas en una sesión presencial: 2 de diciembre de 2017 en horario de 9:00h a 12:00 hrs.
- Se impartirá en la Asociación de Bancos de México, 16 de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro, 06000 CDMX, México

## INSCRIPCIONES y ADMISIÓN

- El importe de la inscripción es de \$7,800.00 (no incluye IVA)
- Para solicitar su inscripción al programa, el candidato deberá enviar un correo electrónico manifestando su interés a la dirección: [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx).
- Hay plazas limitadas. Una vez recibido la solicitud de inscripción, se formalizará la inscripción (sujeta a disponibilidad) enviando un correo electrónico de confirmación a la dirección de email que figure en la solicitud e iniciando los trámites de facturación. Antes del comienzo del curso deberá enviarse copia de la transferencia bancaria o de la forma de pago realizada, confirmando el abono del importe de la matrícula.
- 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 matrícula siempre que se comuniquen con al menos 2 semanas de antelación a la fecha de inicio del curso.



**Afi** Escuela

**ABM**  
ASOCIACIÓN DE BANCOS DE MÉXICO



[www.afiescueladefinanzas.es](http://www.afiescueladefinanzas.es)  
Avenida Paseo de la Reforma 373 piso  
9B, Col. Cuauhtémoc, 06500, 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, México  
5722 4300  
[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)





Formación en  
FINANZAS y TECNOLOGÍA



Curso  
de Especialización en  
**RIESGO  
OPERACIONAL**

**Diciembre 2017**



# Curso de Especialización en RIESGO OPERACIONAL



Diciembre 2017

## 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 contrapartida 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 asociados al **Riesgo Operacional**, 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.

## OBJETIVO

El curso online de **Riesgo Operacional** aborda los aspectos más relevantes de los riesgos inherentes a la actividad de los mercados financieros.

- Estudio de los aspectos teóricos y prácticos del riesgo operacional
- Repaso de las principales herramientas cuantitativas necesarias para el análisis de estos riesgos.

## DIRIGIDO A

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

## METODOLOGÍA

Este curso de especialización en **Riesgo Operacional** se imparte por profesionales de Afi Escuela en colaboración con la Asociación de Bancos de México en México.

Este programa combina una formación ONLINE complementada con una sesión presencial en el que se asientan conceptos a la vez que se ponen en práctica. La formación online ofrece flexibilidad y personalización del ritmo de estudio, ya que el Campus Virtual está disponible las 24 horas, incluido los fines de semana.

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, casos prácticos a través de los que el alumno puede poner en práctica lo aprendido y sobre lo que recibirá feed-back del tutor
- Unidades didácticas en las que se cubren de forma amena los contenidos teóricos, de manera que se facilita el estudio por parte del alumno
- Agenda de trabajo semanal, que ayuda al alumno a planificar su tiempo de estudio
- Tutor experto en cada uno de los temas para resolver dudas, y que propondrá actividades complementarias durante el desarrollo del curso
- Coordinador que dará apoyo al alumno en todo lo referente al funcionamiento de la plataforma online, documentación, etc.

# Curso de Especialización en RIESGO OPERACIONAL



Diciembre 2017

## PROGRAMA

1. Riesgos bancarios
  - Definición de riesgo operacional
  - Importancia del riesgo operacional
2. Marco regulatorio
3. Cálculo de requerimientos de recursos propios
4. Método del indicador básico
5. Método estándar
  - Cálculo de los requerimientos de recursos propios
  - Actividades y componentes de los ingresos relevantes
  - Requisitos para la utilización del método estándar
6. Métodos avanzados
  - Cálculo de los requerimientos de recursos propios
  - Requisitos cualitativos
  - Requisitos cuantitativos
7. Seguros y otros mecanismos de transferencia de riesgo
8. Clasificación de las pérdidas por riesgo operacional en función del tipo de evento
9. Información al mercado
10. Conclusiones

El curso otorga 100 puntos AMIB para revalidar la certificación en Fondos de Inversión y Mercado de Valores.

## 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.

Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales en "Banca y Bolsa" en la Universidad Autónoma de Madrid.

## DURACIÓN, FECHAS Y LUGAR

- Este programa consta de 13 horas de duración.
  - 10 horas en formato online: del 4 al 8 de diciembre de 2017.
  - 3 horas en una sesión presencial: 9 de diciembre de 2017 en horario de 9:00 a 12:00 hrs.
- Se impartirá en la Asociación de Bancos de México, 16 de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro, 06000 CDMX, México

## INSCRIPCIONES y ADMISIÓN

- El importe de la inscripción es de \$7,800.00 (no incluye IVA)
- Para solicitar su inscripción al programa, el candidato deberá enviar un correo electrónico manifestando su interés a la dirección: [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx).
- Hay plazas limitadas. Una vez recibido la solicitud de inscripción, se formalizará la inscripción (sujeta a disponibilidad) enviando un correo electrónico de confirmación a la dirección de email que figure en la solicitud e iniciando los trámites de facturación. Antes del comienzo del curso deberá enviarse copia de la transferencia bancaria o de la forma de pago realizada, confirmando el abono del importe de la matrícula.
- 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 matrícula siempre que se comuniquen con al menos 2 semanas de antelación a la fecha de inicio del curso.



[www.afiescueladefinanzas.es](http://www.afiescueladefinanzas.es)  
Avenida Paseo de la Reforma 373 piso  
9B, Col. Cuauhtémoc, 06500, 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, México  
5722 4300  
[educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)

