

ASSET & LIABILITY MANAGEMENT



MAYO 2019
SANTIAGO DE CHILE





Marcelo Rodríguez

Scotiabank
Toronto

Ingeniero Comercial con Maestría en Finanzas, con más de 20 años de experiencia en mercados financieros latinoamericanos. Extensiva experiencia en el desarrollo, *marketing* y negociación de productos financieros tanto con objetivos de negociación como de manejo de balance. Ha sido responsable de las áreas de *Asset & Liability Management* en diversas instituciones en distintas jurisdicciones dentro de Latinoamérica, introduciendo conceptos tales como precios de transferencia diferenciados, además del uso de productos derivados con propósitos de administrar las condiciones de liquidez y tasa de interés, así como de optimizar el manejo de portafolios de inversión.

Adicionalmente, se ha desempeñado en múltiples roles dentro de la industria financiera y bancaria, incluyendo la gestión de riesgos financieros tanto en lo relativo al manejo de balance (ALM) como a riesgos de portafolios de trading, emisión de notas estructuradas, negociación de productos derivados, y consejero de fondos de inversión.

Ha ejercido actividades académicas internacionalmente, tanto en Universidades como en otros organismos académicos, en diversas materias del ámbito financiero y bancario en múltiples países de la región.

Actualmente, es Vice President & Regional Treasurer para Scotiabank en Canadá, siendo responsable de la gestión del balance de múltiples países, incluyendo el manejo de liquidez y fondeo, el riesgo estructural de tasas de interés, y el manejo del portafolio de inversiones financieras.

DESCRIPCIÓN

El curso *Asset & Liability Management* es una excelente combinación teórico-práctica del manejo de balance de instituciones financieras, poniendo en perspectiva por un lado la gestión activa de los riesgos financieros, y por el otro los objetivos estratégicos que permitan un crecimiento sustentable de los ingresos de un Banco o Institución Financiera. La cambiante realidad de la industria financiera luego de la crisis financiera de 2007/2009, ha puesto muchísima más relevancia a la gestión de activos y pasivos, introduciendo nuevas prácticas, métricas y regulaciones en lo relativo a manejo de liquidez, capital, y riesgos de tasas de interés de balance de un Banco, entre otros aspectos que son cubiertos de manera tanto teórica como prácticas en este módulo.

OBJETIVOS

Comprender la naturaleza de los riesgos y retornos en una instituciones financiera, comprender la evolución de las regulaciones de capital de la industria financiera, y sus principales diferencias, teoría y Práctica del Manejo de Liquidez, teoría y Práctica de manejo de riesgo de tasas de interés, Instrumentos disponibles para gestión de riesgos de balances y precios de Transferencia.

TEMARIO

1. Introducción: ¿Qué es Asset & Liability Management?
2. Naturaleza de los Riesgos y Retornos
3. Regulaciones de Capital
 - 3.1. Evolución en la Banca
 - 3.2. Cómputos de Capital
4. Manejo de Liquidez
 - 4.1. Cash Flow Gaps
 - 4.2. Supuestos
5. Manejo y medición de riesgo de tasa de interés
 - 5.1. Impacto en Margen
 - 5.2. Valor económico
 - 5.3. Modelos de simulación
6. Herramientas de gestión y hedging
 - 6.1. Derivados
 - 6.2. Otros instrumentos
7. Mediciones de rentabilidad
 - 7.1. El rol de los precios de transferencia
8. Vida contractual versus vida esperada

REQUISITOS:

Para lograr un óptimo aprovechamiento a lo largo del Diplomado, se recomienda a los participantes ser egresados de áreas de carreras económico - administrativas, contar con una formación Matemática de nivel medio y/o superior, y/o tener experiencia profesional dentro de instituciones del medio financiero.

Es fundamental que el participante cuente con Computadora Personal (Lap Top) con tarjeta de red inalámbrica para los módulos y talleres en donde sea requerida.

CALENDARIO

SEDE: Isidora Goyenechea 3520, piso 1,
los condes, Santiago Chile

COSTO: \$1,500 USD

HORARIO:
9:00 am - 6:00 pm

DURACIÓN:
2 clases (16 horas)

MAYO 2019

D	L	M	M	J	V	S
			1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23	24	25
26	27	28	29	30	31	

REGISTRO E INSCRIPCIONES

E-mail: derivatives@riskmathics.com
kleon@riskmathics.com

Teléfonos (México):
+52 (55) 5536 4325
+52 (55) 5638 0907

OPCIONES DE PAGO

1. Residentes e instituciones establecidas en el extranjero

Transferencia Bancaria en Dólares

BANCO: BBVA Bancomer

SUCURSAL: 0956

SWIFT: BCMRMXMM

BENEFICIARIO: RiskMathics, S.C.

CUENTA: 0121 8000 11 0583 0066

2. Pago vía telefónica

Tarjeta de crédito VISA, MASTERCARD o AMERICAN EXPRESS

1. NOTA IMPORTANTE: No hay reembolsos, ni devoluciones



WWW.RISKMATHICS.COM