



Curso de preparación para el examen Financial Risk Manager (FRM™) de GARP

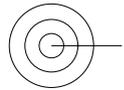
Programa de formación para Gestores en Riesgos
Financieros

XX Edición
Noviembre 2023 – Noviembre 2024

Dirigido a

Profesionales de las Áreas de Gestión de los Riesgos Financieros, preferiblemente con experiencia, que estén interesados en obtener la certificación FRM™ de la Asociación Internacional GARP y, adicionalmente, ampliar su conocimiento en la medición y gestión de los riesgos financieros y no financieros.

Desde el año 2003, el Club de Gestión de Riesgos de España lleva organizando de manera continua programas de preparación para el examen FRM™. La presente convocatoria constituye la vigésima edición del curso.



Objetivos del Curso

1

Preparación de candidatos solventes para las pruebas del examen Financial Risk Manager (FRM™) de GARP en niveles: Level I y Level II:

- GARP (Global Association of Risk Professionals) es una organización independiente y sin ánimo de lucro integrada por profesionales y académicos de la gestión de riesgos financieros a nivel mundial
- El programa de certificación global Financial Risk Manager FRM™ está reconocido en el mundo como uno de los certificados más prestigioso para acreditar las capacidades de un gestor de riesgos financieros. GARP convoca anualmente pruebas para obtener la acreditación como Financial Risk Manager (FRM™).

- Los profesionales poseedores de este título son altamente valorados tanto en las entidades financieras como en las firmas de consultoría especializadas en la gestión de los riesgos.

2

Adquisición de los conocimientos fundamentales necesarios en todo buen gestor de riesgos.





Profesorado

Está formado por reconocidos profesionales de la industria, de la consultoría financiera, así como de entidades y organismos de supervisión y regulación bancaria cuya actividad se focaliza en la medición, gestión y control de los riesgos financieros y no financieros.

A continuación, se citan algunos de los profesores:

- *Carazo Hitos, José Luis*
- *De Celis Lamúa, Javier*
- *De Juan Herrero, Juan Antonio*
- *Espiga Garrofé, David*
- *Falgueras Sureda, Xavier*
- *Ferreras Salagre, Alberto*
- *García Céspedes, Juan Carlos*
- *García Céspedes, Rubén*
- *García Martín, David*
- *Manero Jarnes, Rodrigo*
- *Manzano Carpio, Francisco*
- *Ramirez Nicolás, Fernando*
- *Torras Muñoz, Óscar*



Documentación

Durante el curso se entregará a los alumnos documentación en formato electrónico relativa a cada uno de los temas y sesiones que les servirá como base para superar las pruebas de la acreditación.



La dirección se reserva el derecho a modificar el profesorado o calendario por necesidades del programa.



Programa Online

El programa se adapta a los contenidos necesarios para conseguir la titulación FRM™. La certificación FRM™ de GARP consta de 2 niveles. Durante cada año, GARP organiza exámenes para aprobar cada uno de ambos niveles. Es preciso superar el examen del Nivel I para poder acceder al examen del Nivel II.

Los exámenes de ambos niveles se realizan en inglés. Con objeto de que el alumno pueda prepararse adecuadamente para los mismos, el material del curso es mixto (español e inglés), si bien los ejercicios y los simulacros de examen serán en inglés para obtener una preparación más práctica y efectiva. En este sentido es conveniente que el alumno disponga de al menos un nivel básico de lectura de idioma inglés. Las sesiones se realizarán en idioma castellano.

El curso está diseñado para que de manera natural los alumnos se puedan presentar en las convocatorias de mayo de 2024 al examen del primer nivel y en noviembre de 2024 al del segundo nivel, de manera que si el curso es realizado con aprovechamiento el alumno al cabo de un año pueda conseguir la acreditación completa.

Las clases son en formato online-directo con la opción posterior de acceder a las clases grabadas, por ello **es imprescindible que el alumno disponga de un ordenador personal, con conexión a internet, cámara, micrófono y suficiente ancho de banda.**

Para un mejor aprovechamiento del curso, **los alumnos deben tener en todo**

momento conectados y operativos sus cámaras y micrófonos, de manera que los alumnos puedan interrumpir al profesor si fuese necesario para plantear dudas sobre la materia que se explique. Así mismo, de manera simétrica, el profesor podrá dirigir preguntas y cuestiones a los alumnos por lo que tener habilitadas las cámaras y micrófonos facilita y mejora la interacción alumno-profesor.

Las clases online-directo serán habitualmente los viernes de 16,30 a 21 horas (con 30 min de descanso).





Programa Online

El alumno podrá revisar las grabaciones de las clases en el caso de que no haya podido asistir a la sesión en directo o bien para reforzar los conocimientos de las materias.

Las sesiones serán tanto teóricas como prácticas (durante las que se realizarán ejercicios). Como se ha comentado, el formato online-directo permite al alumno plantear las dudas de forma inmediata al profesor, no obstante, los profesores están a disposición de los alumnos para resolver las dudas que posteriormente a la clase se les puedan plantear (vía email).

La documentación soporte del curso se distribuirá en formato electrónico a los alumnos.

La documentación de las sesiones teóricas consta de:

- Una presentación extensa con los contenidos detallados de la sesión.
- Una presentación resumen de la sesión (con aproximadamente 5 transparencias) que permite al alumno un repaso rápido de todo el temario de cara al examen.
- Un set de ejercicios para resolver posteriormente a la sesión.
- Las soluciones a dichos ejercicios.

La documentación de las sesiones prácticas consta de:

- Un set de ejercicios para resolver durante la sesión.
- Posteriormente se reparte un documento con las soluciones a los ejercicios resueltos durante a la sesión.

Durante el curso se realizan dos simulacros de examen que tratan de replicar las condiciones en las que se encontrará el alumno durante el examen oficial. Los simulacros de examen tendrán lugar un jueves por la tarde y se realizarán en remoto.

Los ejercicios de dichos simulacros posteriormente se resuelven durante sesiones específicas online en horario habitual de viernes.





Contenido y materias cubiertas

En el curso se cubren las materias siguientes:

- Estructuras y Funciones de las Instituciones Financieras
- Fundamentos de Gestión del Riesgo y Gestión Integral del Riesgo
- Probabilidad y Estadística
- Métodos de Simulación
- Renta Variable, Divisas y Mercaderías
- Instrumentos de Renta Fija
- Derivados Financieros
- Tipos de Riesgos e identificación de Factores de Riesgo
- Riesgo de Mercado: Metodologías VaR, Expected Shortfall
- Riesgo de Mercado: Backtesting y Stress Testing
- Riesgo Crédito
- Modelos Comerciales de Riesgo de Crédito y estudio de casos reales
- Exposición Crediticia y Riesgo de contraparte
- Derivados de Riesgo de Crédito
- Riesgos No Financieros: Operacional, Cumplimiento
- Riesgo Liquidez
- Riesgo Soberano y evaluación de Riesgo País
- Stress Testing
- Hedge Funds
- Acuerdo de Capitales de Basilea, Capital Económico, RAROC
- Artificial Intelligence, Machine Learning y Big Data
- Ciberseguridad
- Riesgos climáticos



GARP agrupa los contenidos anteriores en dos exámenes que cubren los siguientes bloques de materia:

EXAMEN NIVEL I

- Foundations of risk management
- Quantitative analysis
- Financial markets and products
- Valuation and risk models

Las diferentes sesiones del curso se adaptan a las agrupaciones de contenidos y bloques definidos por GARP.

Es posible que durante el desarrollo del curso, GARP modifique el contenido/ lecturas del examen. En tal caso, se incluirían las sesiones adicionales necesarias para dar cobertura al nuevo temario.

EXAMEN NIVEL II

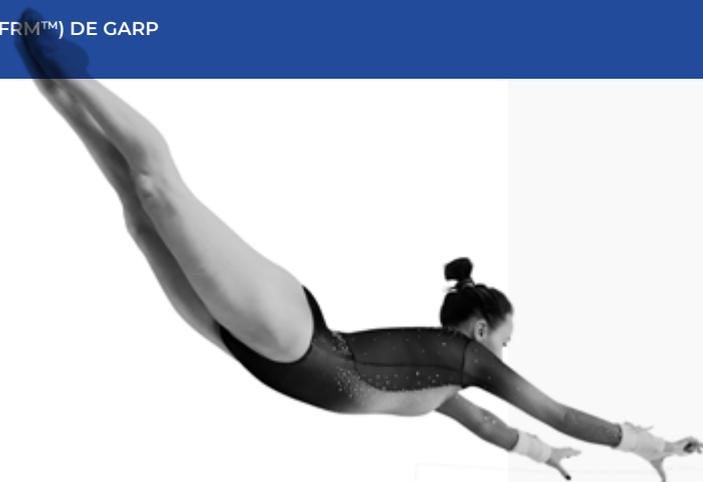
- Market risk measurement and management
- Credit risk measurement and management
- Operational risk and resiliency
- Liquidity and treasury risk measurement and management
- Risk management and investment management
- Current Issues in financial markets

Diploma

Aunque el objetivo principal del curso es la obtención del título FRM™, está previsto que a la finalización del curso se entregue un diploma que acredite la realización del curso por parte del alumno.

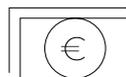
Para obtener el diploma serán condiciones necesarias un nivel de asistencia suficiente (se controlará el nivel de asistencia al curso), así como participar en las sesiones de simulacro de examen de que consta el propio curso.





Duración y Fechas

El curso consta de **148 horas de clase**, repartidas en **37 sesiones de 4 horas** cada una, y de dos simulacros de examen (uno para cada uno de los dos niveles del curso). El curso se desarrollará entre los meses de noviembre de 2023 y noviembre de 2024.



Precio

El importe de la matrícula asciende a **3.400 euros para los alumnos que, siendo Socios o empleados de Socios Protectores, se matriculen al curso completo.**

Todos aquellos interesadas en hacer el curso que no fuesen socios, podrán optar al mismo tras hacerse socios del Club (cuota de 100€ por año).



Fecha prevista de inicio

Viernes
24 de noviembre de 2023

Este precio no incluye ni la inscripción ni las tasas del Examen Oficial FRM™ de GARP que corren por cuenta del alumno, para lo cual hay información en el siguiente link de la página web de GARP:

<https://www.garp.org/frm>

Solicitud de Inscripción

Los interesados han de enviar la siguiente información, antes 10 de noviembre de 2022, a la dirección de correo electrónico

info@clubgestionriesgos.org

Nombre
CIF/NIF
Domicilio
C.P. y Ciudad
Teléfono
Email
Entidad
Departamento
Licenciatura
Universidad

La inscripción, previa admisión por la organización, se formalizará mediante ingreso del importe de la matrícula.

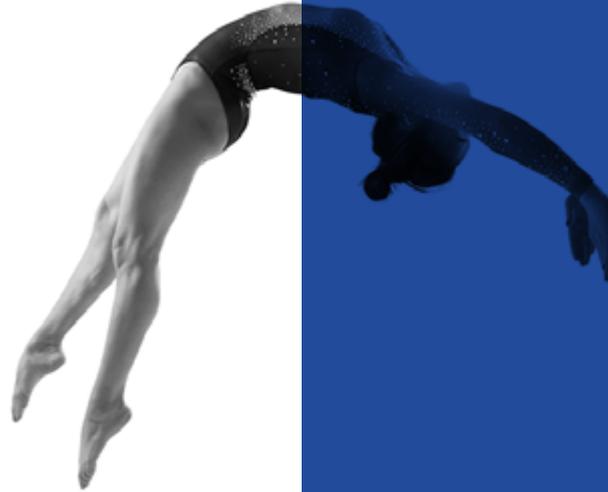
“Te informamos que tus datos e imágenes serán recabados por Club de Gestión de Riesgos España de acuerdo con lo que marca la normativa de protección de datos, derecho al honor y la imagen y demás normas de aplicación. Tus datos no serán compartidos salvo corresponda por ley o por vinculación contractual. Si quieres puedes ejercer tus derechos en cualquier momento y obtener más información consultando nuestra Política de Privacidad”.

Más información: <https://www.clubgestionriesgos.org/politica-de-privacidad/>

Organiza



Club de Gestión de Riesgos de España



Directores del curso

Juan Carlos García Céspedes
David García Martín (FRM 2002)
David Espiga Garrofé (FRM 2004)

Información e inscripción

www.clubdegestionriesgos.org
info@clubdegestionriesgos.org

Teléfono
+34 609 37 42 52