

Curso de Especialización

# Evaluación de Suficiencia de Capital (ICAAP) para Banca Múltiple

Del 19 al 28 de agosto de 2025

**Afi** Global  
Education



**ABM** ASOCIACIÓN DE  
BANCOS DE  
MÉXICO

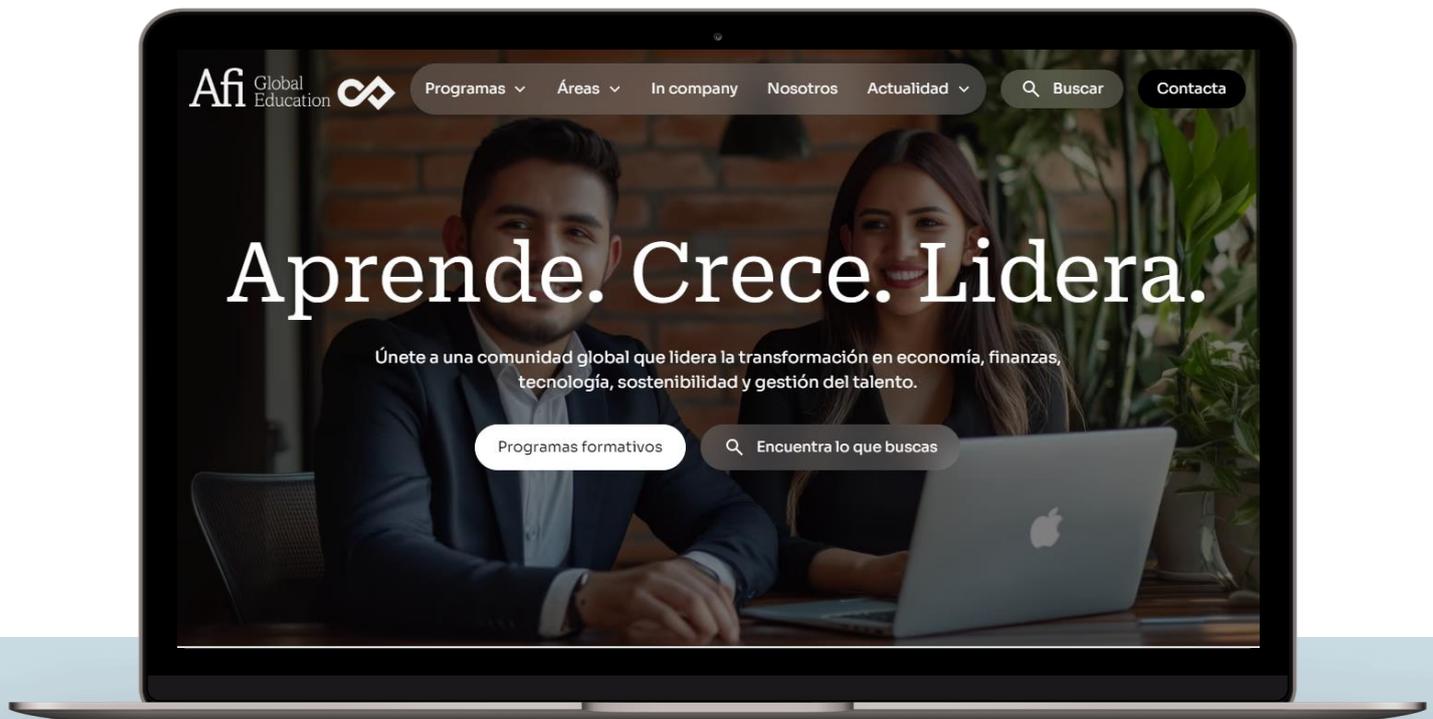
# Quiénes somos

Con más de **35 años** de experiencia, **Afi** es una compañía española líder en asesoramiento, consultoría y formación en áreas de banca, economía, finanzas y tecnología.

Como complemento a su labor, desde hace más de 30 años, inicia labores **Afi Global Education** consolidándose como una Institución de referencia en lengua castellana a nivel internacional, en economía, finanzas, tecnología, sostenibilidad y gestión del talento. En el 2017, ingresa al mercado mexicano como parte de su estrategia de internacionalización en América Latina.

## Los 5 pilares fundamentales de Afi Global Education

-  Innovación continua
-  Excelencia académica
-  Selección de talento
-  Metodología avanzada
-  Colaboración con empresas líderes





## Curso de Especialización en Evaluación de Suficiencia de Capital para Banca Múltiple

# Objetivos

Las crisis, caracterizadas por auges insostenibles seguidos por estrepitosas caídas, siempre han estado con nosotros, y con nosotros siempre estarán. Es por esto que el Ejercicio de Suficiencia de Capital, como parte fundamental del proceso de gestión de riesgos, nos permitirá contar con información de valor agregado para la toma de decisiones bajo escenarios de estrés. Esta formación busca:

- Contar con un conocimiento general del Ejercicio de Suficiencia de Capital requerido por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores a las Instituciones de Banca Múltiple.
- Conocer y ejercitar las principales técnicas para la proyección de estados financieros, cálculo de activos ponderados sobre riesgo y cálculo de índice de capital.

## Dirigido a:

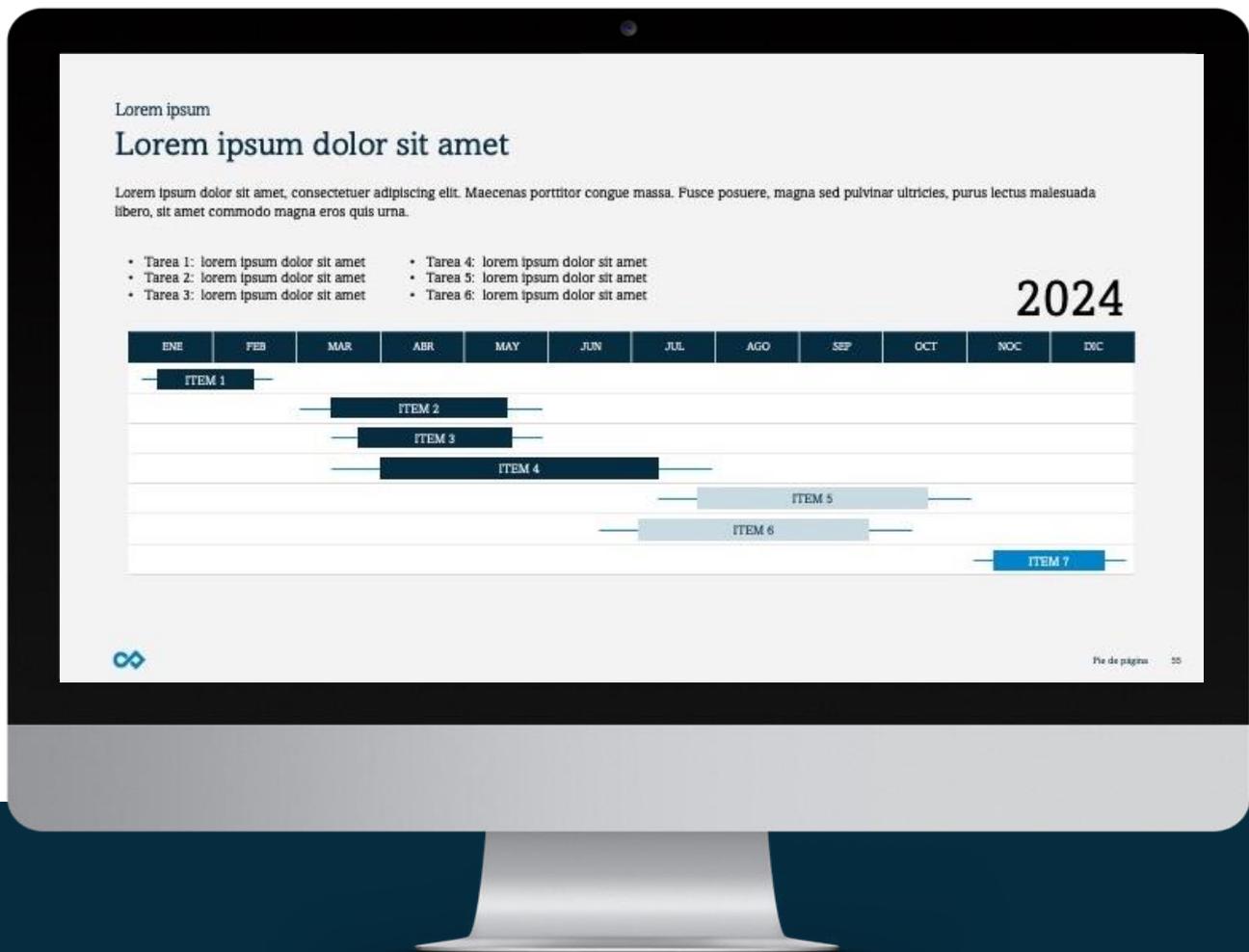
- Profesionales involucrados en la toma de decisiones relacionados a los niveles de capitalización de instituciones financieras de banca múltiple.
- Administradores de riesgos.
- Tesoreros.
- Auditores.

# Metodología

## Streaming a distancia en tiempo real

El curso se realiza en modalidad streaming a distancia en directo a través de nuestra Aula Virtual (plataforma Zoom).

Este enfoque práctico y orientado a la resolución de problemas permite que los participantes, cuando acaben la formación, tengan la preparación necesaria para enfrentarse a los desafíos del mundo laboral.



# Programa

## 01. Proceso de Gestión de Riesgos

- Definiciones y conceptos esenciales.
- Clasificación de los riesgos financieros.
- Etapas del proceso de gestión de riesgos.
- 2008 la crisis de crédito y el contagio sistémico..

## 02. Lineamientos y Entregables del ESC

- Calendario.
- Manual y Formulario.
- Diseño Inicial y Final del ESC.
- Supuestos CNBV e Internos.
- Documento Cualitativo y Formulario.

## 03. Análisis Financiero

- Balance y Resultados.
- Análisis de reserva y Costo de Crédito.
- Indicadores de Solidez Financiera.

## 04. Proyecciones Financieras

- Métodos de proyección.
- Proyección de Balance y Resultados.
- Estimación Preventiva de Riesgos de Crédito (EPRC).

## 05. Activos Ponderados Sobre Riesgo

- Riesgos de Crédito.
- Riesgos de Mercado y Liquidez.
- Riesgo Operativo.

## 06. Evaluación de Capital

- Normativa y límites regulatorios.
- Análisis de suficiencia de liquidez y capital.
- Acciones conducentes.

## 07. Planes de Contingencia y Resolución

- Acciones contingentes.
- Medición de impacto en liquidez y capital.
- Plan de resolución.

# Claustro académico



**Gerardo Alberto Zamudio Ríos**  
VP de Planeación y Análisis Financiero en Citibanamex



**Mauricio Beltrán**  
Sr VP Regulatory risk at Citibanamex.

- *Los ponentes podrían variar por causas de fuerza mayor.*

# Constancia

- Al concluir el curso todos los participantes que hayan asistido al menos al 80% de las sesiones, recibirán una constancia de participación.



## Duración, fecha y lugar

Con una duración total de **18 horas en streaming en tiempo real**, las sesiones del curso se realizarán a través del **Aula Virtual**, del **19 al 28 de agosto de 2025**, de **17:00h a 20:00h (hora México)**.

AGOSTO						
Lun	Mar	Mié	Jue	Vie	Sáb	Dom
28	29	30	31	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



### Monto de inversión

El monto de inversión por participante es de:

**\$27,000 más IVA**

- Si es miembro de la Asociación de Bancos de México - ABM consulte la promoción disponible para asociados.

# Formalización de la inscripción y condiciones generales

## Plazas limitadas

- ❑ Se formalizará la inscripción enviando un correo a **educacioncontinua@abm.org.mx** y/o **afiglobaleducationmexico@afi.es** con el comprobante de pago antes del inicio del curso.
- ❑ El inicio del curso está sujeto a alcanzar el quórum requerido para la correcta ejecución de la metodología.
- ❑ Las cancelaciones deberán comunicarse por escrito a la dirección de correo electrónico **educacioncontinua@abm.org.mx** y/o **afiglobaleducationmexico@afi.es** y darán derecho a la devolución del 100% del importe de la inscripción, siempre que se comuniquen al menos 2 semanas antes a la fecha de inicio del curso.
- ❑ En determinados supuestos, se podrá acordar la sustitución de la persona inscrita por otra de la misma empresa, hasta el día anterior al inicio del curso, previa comunicación por escrito a Afi Global Education.

## Contacto:



✉ [afiglobaleducationmexico@afi.es](mailto:afiglobaleducationmexico@afi.es)

☎ +52 (55) 91 99 77 53  
+52 (56) 41 75 41 74

☎ +52 (55) 88 40 97 77



✉ [educacioncontinua@abm.org.mx](mailto:educacioncontinua@abm.org.mx)

☎ +52 (55) 57 22 43 92



## Afi Alumni

Después de 30 años de actividad, Afi Global Education ha formado una amplia comunidad de profesionales en el ámbito económico, financiero, tecnológico y de la sostenibilidad.

Afi Alumni es un servicio destinado a antiguos alumnos, que ofrece los siguientes beneficios:

- ❑ **Formar** parte de la comunidad de antiguos alumnos para facilitar y promover las relaciones profesionales y sociales entre antiguos alumnos.
- ❑ **Contribuir** al desarrollo profesional de los miembros mediante actividades de formación y orientación profesional.
- ❑ **Facilitar** contenido e informes sectoriales elaborados por el Grupo Afi, así como el envío periódico de la revista especializada del Grupo.
- ❑ **Fomentar** la relación de los antiguos alumnos con Afi Global Education y el Grupo Afi, creando una red de conocimiento en temas económico-financieros y tecnológicos.

### Networking

Eventos anuales Alumni | Jornadas Open Alumni  
| Jornadas Sectores | *Lead by Experience Journeys*

### Desarrollo Profesional

Formación especializada | Beneficios para  
formación y desarrollo | Bolsa de empleo |  
Servicios de carreras profesionales

# www.afiglobaleducation.mx

## **Campus México:**

Av. Paseo de la Reforma 296  
piso 25-127. Col. Juárez, Del. Cuauhtémoc.  
C.P. 06600. CDMX, México.  
+52 (55) 88 40 97 77  
+52 (55) 91 99 77 53  
+52 (56) 41 75 41 74

 [afiglobaleducationmexico@afi.es](mailto:afiglobaleducationmexico@afi.es)

 <https://afiglobaleducation.mx/>

## **Campus España:**

C/Marqués de Villamejor, 5.  
C.P. 28006 Madrid, España

 [afiglobaleducation@afi.es](mailto:afiglobaleducation@afi.es)

