

Valoración ajustada por Riesgo de Contraparte

Módulo VIII

Virtual en Vivo



INICIO

13

Sábado
Junio

2 sesiones

Sab. y Dom.
8:30 am - 11:30 am
(hora de Perú)

COSTO

US\$ 210 + IGV

En este curso se dotará al participante de conocimientos para distinguir las fuentes de riesgo financiero a las que se enfrentan las empresas financieras y no financieras. Se analizarán los instrumentos que tienen las empresas para gestionar y cubrirse de los riesgos financieros. Se presentará cómo gestionar, cuantificar y medir el riesgo utilizando **MS Excel**.

TEMAS

- Conceptos preliminares
- Estimación de parámetros:
 - > PD, LGD, EAD, PFE, etc)
- IFRS9
- Exposiciones típicas de instrumentos financieros:
 - > IRS, CCS...
- Modelos para estimación de las exposiciones:
 - > Tipos de interés, FX, crédito...
- Valuation Adjustments (XVAs)
 - > Credit Valuation Adjustment (CVA)
 - > Funding Valuation Adjustment (FVA)
 - > Capital Valuation Adjustment (KVA)
 - > Debit Valuation Adjustment (DVA)
 - > Margin Valuation Adjustment (MVA)
- Wrong Way Risk

Curso 100% Práctico con MS Excel



Alineado a tendencia internacional

- **Basilea IV**
- **FRTB**
- **IRRBB**
- **CVA**
- **IFRS9**
- **Solvencia II**

Evaluación supervisada en cada módulo

Plana Docente

- Directora del área de consultoría y análisis de riesgos, más de 100 proyectos relacionados a valoración, riesgos e implementación metodológica. Profesional de la Univ. Carlos III de Madrid, IEB, FRM, Basel III Compliance Professionals Association.
- Head of Valuation and Pricing Unit at Corporate and Investment Banking, amplia experiencia en Riesgos Financieros (Valuation, Market Risk). Profesional de la Univ. Carlos III de Madrid, MSc. Financial Analysis, MSc. Quantitative Finance, FRM.



Mayor Información

✉ info@quants-group.com

☎ 938 117 737

www.quants-group.com