

Marco normativo

Sobre la gestión de riesgos - Basilea

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

- Regulación Bancaria
 - > Principales organismos y sectores regulados
- Basilea I
 - > Bases y conceptos generales
 - > Activos Ponderados por Riesgo y Ratio de Solvencia
- Basilea II - II.5
 - > Los tres Pilares
 - > Introducción del riesgo operativo
 - > Mejoras en los modelos estándares (crédito, mercado)
 - > Modelos internos. VaR, IRB, etc
- Basilea III - IV
 - > Crisis de 2008
 - > Incorporación de métricas de riesgo de liquidez
 - > Entidades sistémicas, buffer anticíclico, ratio de apalancamiento
 - > Mod. en los recursos propios exigibles y admisibles

Módulo IV

Virtual en Vivo



INICIO

02 Sábado
Mayo

2 sesiones

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

COSTO

US\$ 210 + IGV

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