

Riesgo de Mercado

En el Banking Book

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 generales
- Balance de una entidad de crédito. Activos y Pasivos
- Riesgo estructural
 - > Riesgo de tipo de interés (curva, opciones implícitas, tasa de cambio...)
- Medición del riesgo de mercado en banking book:
 - > IRRBB
 - > ALM
 - > EVE (Valor económico)
 - > NII (Margen financiero)
 - > Stress (sensibilidad del EVE / NII)
 - > Criterios de modelización:
 - >> Reducción a model points
 - >> Tratamiento de la opcionalidad conductual en los depósitos y otros aspectos
 - > Ejemplos prácticos

Módulo VI

Virtual en Vivo



INICIO

30 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