

# Riesgo de Mercado

## En el Trading Book

### Módulo V

Virtual en Vivo



## INICIO

09 Sábado  
Mayo

5 sesiones

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

**COSTO**

US\$ 525 + IGV

## TEMAS

- Conceptos generales
- Métricas clásicas para la medición del riesgo de mercado del portafolio
  - > Value-at-Risk y Expected Shortfall
  - > Métodos de cálculo
    - >> Paramétrico, mapping, histórico, Monte Carlo
    - >> Ejemplos con instrumentos y portafolios mixtos
  - > Modelos de Stress test
  - > Backtesting
- FRTB, revisión normativa y puesta en práctica
  - > Claves y principales impactos
  - > Método estándar (SA)
    - >> Sensibilidades (delta, vega, curvatura): GIRR, CSR, EQ, FX, CM
    - >> Default Risk charge: Deuda & EQ
    - >> Residual Risk add on
  - > Método Avanzado (IMA)
    - >> Horizontes temporales
    - >> Credit spread Risk
    - >> Expected Shortfall
    - >> Default Risk charge: modelo interno
    - >> PL Attribution
  - > Default Risk Charge (DRC)
  - > Non Modelable Risk Factors (NMRF)

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](mailto:info@quants-group.com)

☎ 938 117 737

[www.quants-group.com](http://www.quants-group.com)