



Riesgo de Liquidez

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

- Riesgo de liquidez de mercado
 - > Ilíquidez potencial en los instrumentos financieros
 - > Parámetros de estimación del riesgo:
 - >> A nivel instrumento
 - >> A nivel portafolio
 - > Modelos de stress test, escenarios, liquidación forzosa
- Riesgo de liquidez de fondeo
 - > Impacto del pasivo en la gestión del riesgo de liquidez:
 - >> Banca, fondos de inversión o de pensiones
 - > ALM. Análisis GAP
- Ratios de liquidez de Basilea III:
 - > HQLA
 - > LCR
 - > NSFR
 - > Modelos internacionales y locales
- Marco de control del riesgo de liquidez

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.

Módulo VII

Virtual en Vivo



INICIO

06 Sábado
Junio

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



Mayor Información

✉ info@quants-group.com

☎ 938 117 737

www.quants-group.com