

Curso Virtual

Riesgo de Mercado

Enfoque Regulatorio y Práctico

Dirigido a profesionales que se desempeñen en áreas relacionadas a riesgo de mercado, y en general profesionales que estén interesados en ampliar sus conocimientos regulatorio peruano y su respectiva puesta en práctica.

TEMAS

- 1- Valorización de Instrumentos Financieros **(8 horas)**
 - Concepto y valoración de Bonos
 - Concepto y valoración de CDS
 - Concepto y valoración de Derivados (FWD y Swap – CCS, IRS)
 - Registro y clasificación según norma SBS:
 - > Disponible para la venta
 - > A vencimiento
 - > A valor razonable con cambios en resultados
 - Casos prácticos: Valoración de los instrumentos y registros
- 2- Métricas de riesgo de mercado **(4 horas)**
 - Value at Risk (VaR)
 - Conditional Value at Risk (CVaR)
 - Stress Value at Risk (SVaR)
 - Stress Conditional Value at Risk (SCVaR)
 - Lineamientos para el establecimiento de límites de riesgo
- 3- Riesgo Estructural Regulatorio **(10 horas)**
 - Riesgo Estructural de Tasa de Interés (Anexo 7)
 - > Revisión de la norma, conceptos diversos detrás del anexo
 - > Aplicación práctica de elaboración de reporte
 - Riesgo Estructural de Liquidez (Anexo 16)
 - > Revisión de la norma, conceptos diversos detrás del anexo
 - > Aplicación práctica de elaboración de reporte
- 4- Deterioro de Valor **(2 horas)**
 - Revisión de la norma SBS y aplicación mediante caso prácticos

INICIO

29 **Sábado**
Febrero

6 clases / 24 horas

Sábado
10:15 am - 13:15 pm

COSTO

USD 700 + IGV

Curso Presencial

Sede San Isidro - Lima, Perú



Mayor Información

✉ info@quants-group.com

☎ +51 938 117 737

www.quants-group.com

