

Fundamentos Cuantitativos para

Módulo I

Virtual en Vivo



Medición de Riesgo de Mercado

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

- Análisis de series temporales
 - > Estadística Descriptiva
 - > Distribuciones de Probabilidad
 - > Métrica de riesgo: Volatilidad, Correlación, Beta, Delta, etc.
- Tasas de Interés
 - > Tipos de Tasas (spot, forward, cálculo de tipos futuros)
 - > Curvas (interb., swap, cupón cero, constr. curva cupón cero)
- Valor temporal del dinero
 - > Descuentos de flujos, proyección de flujos

INICIO

28 Sábado
Marzo

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