



CURSO DE ESPECIALIZACIÓN

► **GESTIÓN DE RIESGO DE MERCADO**

Este curso de especialización presenta los principales aspectos regulatorios vinculados a la gestión del riesgo de mercado, así como las principales técnicas para su gestión con el objetivo de lograr el adecuado entendimiento de los aspectos legales y de autogestión que se desarrollan de manera teórica y se refuerzan con ejercicios prácticos (casos de estudio) dentro de las diferentes etapas propias de la gestión de riesgos.

► OBJETIVOS

1. Interiorizar los principios dentro de la gestión de riesgo de mercado, identificando los factores de riesgo y pasos para una adecuada gestión de los mismos.
2. Conocer y dominar las principales normas vigentes para la gestión de riesgo de mercado.
3. Conocer sobre los conceptos introductorios, mapeo de factores de riesgos y principales métricas para la gestión de los riesgos de mercado.
4. Comprender los modelos de VaR: VaR Paramétrico, VaR Histórico y Var Montecarlo.

► DIRIGIDO A

Directivos, gerentes, ejecutivos y técnicos con implicación en las áreas de: Gestión de activos y pasivos, gestión de riesgos, tesorería, planeamiento de nuevos productos y auditoría interna en empresas del sector financiero que deseen conocer o ampliar sus conocimientos sobre los riesgos de mercado o quieran desarrollar su actividad profesional en la gestión de riesgos.

► INICIO DE CLASES

Del 04 al 20 de noviembre del 2021

► FRECUENCIA

Martes y jueves de 07:00 p.m. a 10:00 p.m.
Sábados de 10:00 a.m. a 01:00 p.m.

► DURACIÓN

24 horas lectivas

► MODALIDAD

A distancia (Clases en tiempo real mediante la plataforma Cisco Webex)

► MONTO DE INVERSIÓN

S/ 1,680.00

AL CONTADO	EN CUOTAS
Abono en cuenta corriente y/o pago con tarjeta de crédito y débito: Visa, Mastercard, American Express y Diners Club	► Consulte por las facilidades de financiamiento
Banco de Crédito del Perú Cuenta corriente en moneda nacional 193-1544418-0-80 N° de cta. interbancario del BCP 00219300154441808014	Scotiabank Cuenta corriente en moneda nacional 000-5212944 N° de cta. interbancario del Scotiabank 00917000000521294422

PRONTO PAGO

20% de descuento hasta dos meses antes del inicio.
10% de descuento hasta un mes antes del inicio.

DESCUENTO CORPORATIVO (Participación de 03 colaboradores de una misma empresa)

25% de descuento del monto total.

PAGO ONLINE

Con tarjeta de débito y/ crédito (Visa, Mastercard, American Express, Diners Club)
elearning.bursen.com.pe

PAGA ONLINE AQUÍ

Stock mínimo 25 cupos por actividad o hasta agotar stock.

► INFORMACIÓN IMPORTANTE

La Bolsa de Valores de Lima se reserva el derecho de devolución de pagos, éste solo procede por reprogramación de la fecha de inicio de la capacitación, cancelación de la misma y por lo señalado en la política de devolución. Además, la BVL se reserva el derecho de reprogramar o cancelar el curso si éste no llega al cupo mínimo requerido hasta el mismo día de inicio de clases, o por otras razones ajenas a su voluntad, lo cual será debidamente comunicado a los inscritos que se identificaron. De presentarse este caso, las devoluciones de pagos efectuados se realizarán en el lapso máximo de 30 días hábiles, desde la cancelación del curso. La BVL se reserva el derecho de modificar el cronograma de clases por situaciones no programadas: sismos, huelgas, imprevistos críticos con los docentes. Asimismo, se reserva el cambio de docentes por enfermedad, accidente o viaje laboral urgente, entre otros.

► TÉRMINOS Y CONDICIONES

Términos y condiciones, [aquí](#)

▶ MALLA CURRICULAR

- Gestión de Riesgos Financieros. Identificación de los Riesgos de Mercado. Caso práctico.
- Regulación de la Gestión de Riesgo de Mercado. Reglamento de Gestión de Riesgo de Mercado. Reglamento de Gestión de Riesgo de Liquidez. Reglamento de gestión de clasificación y Valorización de Inversiones. Reglamento para la Negociación y Gestión de Derivados. Caso práctico y análisis de lecturas.
- Principios de estadística e inferencia en la gestión de riesgo. Nociones de Rentabilidad y Riesgo en el manejo eficiente de portafolios. Caso práctico.
- Valor en riesgo (VaR). VaR Paramétrico. VaR Histórico. VaR Simulación de Montecarlo. Pruebas de Stress. Caso práctico.
- Valorización de Derivados Financieros (Forward, Swaps, Futuros, Opciones). Principales tipos de derivados financieros. Caso práctico.
- Riesgo y Coberturas. Duración. Duración Modificada. Aproximación a la gestión de activos y pasivos: Riesgo de Mercado y Riesgo Estructural, Duración como gestión de activos y pasivos, Aproximación a la gestión de Activos y Pasivos, principales técnicas. Caso práctico.
- Riesgo de Mercado en la Gestión Integral de Riesgos: Marco de Apetito al Riesgo (MAR). Herramientas y Políticas para la Gestión de Riesgo de Mercado. Límites internos. Caso práctico.

▶ DOCENTE



Gerardo Crespo

Profesional de Ingeniería Económica por la Universidad Nacional de Ingeniería. Maestría en Finanzas por la Universidad del Pacífico con mención en Finanzas Corporativas. Estudios de especialización en Métodos Cuantitativos y Software Econométrico aplicado al modelamiento de Riesgo de Crédito. Actualmente es responsable de la Gestión del Riesgo de Crédito en la Corporación Financiera de Desarrollo – COFIDE, Banco de Desarrollo del Perú.

▶ METODOLOGÍA

Teórico - práctica

El curso utiliza el análisis y la lectura de diversas casuísticas con el objetivo de fomentar la discusión y el debate entre los participantes. Los alumnos pondrán en práctica sus habilidades de investigación, análisis, comunicación, innovación, reflejando sus habilidades gerenciales. Asimismo, cada uno de los cursos presenta una evaluación que el alumno deberá aprobar con nota mínima aprobatoria de catorce para acceder a la certificación a nombre de la Bolsa de Valores de Lima y del Grupo BVL.

▶ CISCO WEBEX

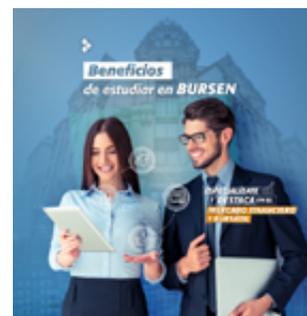
La plataforma Cisco Webex está diseñada para que el alumno pueda interactuar en tiempo real con el docente mediante una computadora, laptop o dispositivo móvil con acceso a internet. El participante podrá escuchar, visualizar y realizar cualquier consulta durante el desarrollo de clases, ya sea por micrófono y/o chat. Asimismo, la plataforma graba las sesiones de estudio, por lo que el usuario podrá reforzar lo aprendido visualizando posteriormente la sesión grabada.

▶ CERTIFICACIÓN

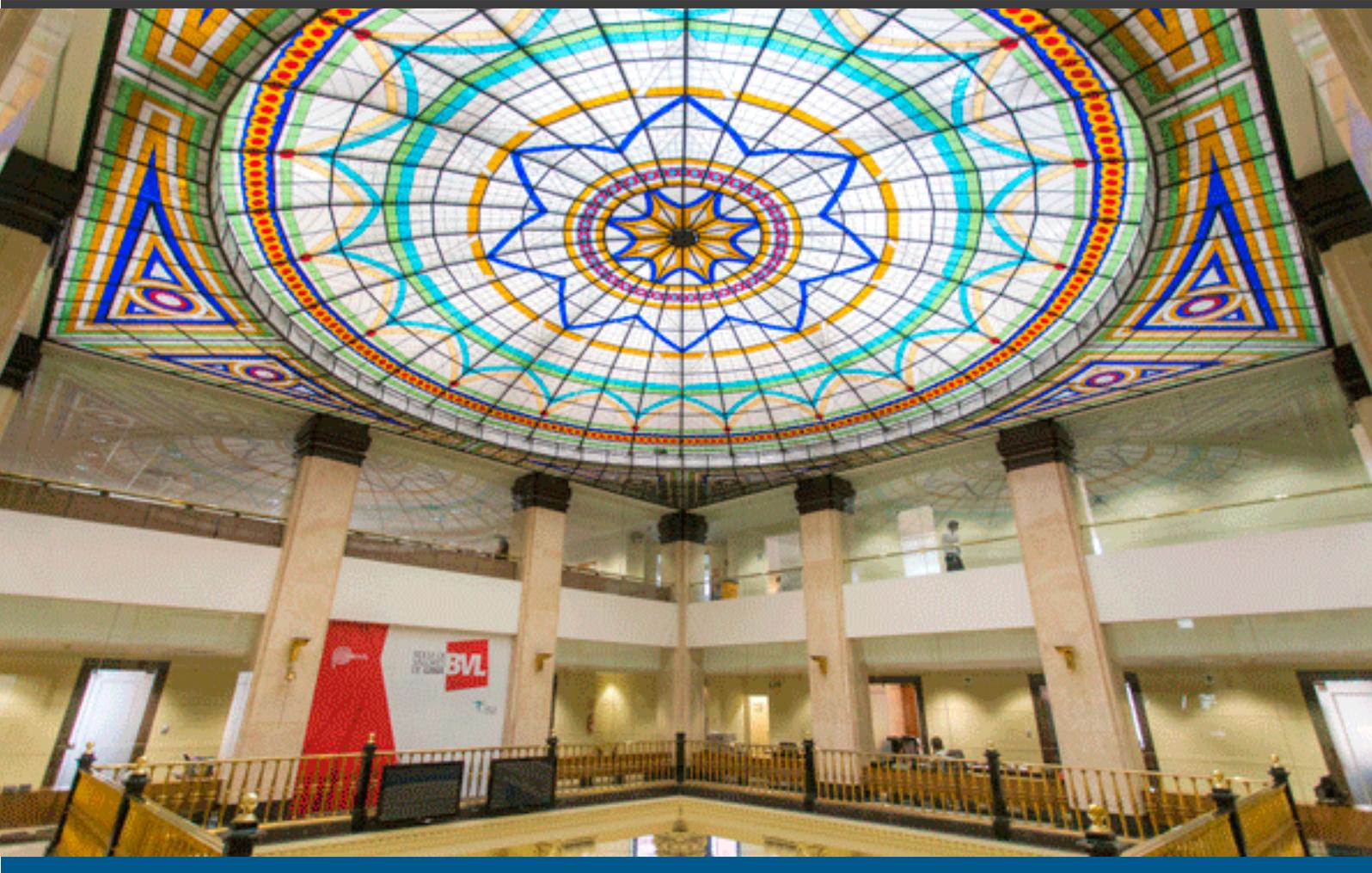
Certificación a nombre de la Bolsa de Valores de Lima y del Grupo BVL.



▶ BENEFICIOS DE ESTUDIAR EN BURSEN-CENTRO DE ESTUDIOS FINANCIEROS DEL GRUPO BVL



- Somos BURSEN-Centro de Estudios Financieros del Grupo BVL.
- Cursos especializados en el mercado financiero y bursátil.
- Certificaciones internacionales en finanzas, mercado bursátil y gestión de riesgos.
- Certificación a nombre de la BVL y del Grupo BVL.
- Docentes expertos en sus áreas de trabajo.
- Metodología teórico - práctica con casuísticas reales que suceden en el mercado laboral.
- Programa Alumni BURSEN con beneficios exclusivos para alumnos y egresados.



CONTACTO



infobursen@bvl.com.pe



bursen



www.bursen.com.pe



@bvlbursen



bursenbvl



Avenida Jorge Basadre 347,
San Isidro