



RIESGO DE MERCADO Y BALANCE

Definiciones clave, **medidas y métricas** utilizadas en la gestión de riesgos financieros.

CERTIFICACIÓN ESPECIALIZADA



DURACIÓN
2 meses



MODALIDAD
Sincrónica y Asincrónica



ENFOQUE PRÁCTICO
Conceptos de gestión en situaciones reales



DEDICACIÓN
40h

OBJETIVOS

Aprende sobre las estrategias y herramientas utilizadas para mitigar el riesgo de mercado, como la diversificación de cartera, el uso de derivados financieros y estrategias de cobertura.

Identificar y cuantificar el riesgo de mercado en diferentes tipos de activos financieros, como acciones, bonos, divisas y materias primas. Se analizarán las técnicas de valor en riesgo (VaR), sensibilidad a las tasas de interés, y otros métodos de medición de riesgo.

PROGRAMA

- Productos y mercados financieros
- Riesgo de mercado
- Riesgo de modelo
- Riesgo de contrapartida
- Definición de riesgos estructurales: identificación
- Riesgo de tipo de interés
- Riesgo de liquidez y financiación
- Otros riesgos estructurales
- Requerimientos regulatorios

