



## **RISK-06: GESTIÓN DE RIESGO MERCADO: CAMBIARIO Y TASAS DE INTERÉS**

### **OBJETIVO:**

El curso 100% práctico, está dirigido a los funcionarios cuyas funciones y responsabilidades estén relacionadas a la gestión de riesgos de liquidez y mercado (cambiario y tasas de interés). Al término de la capacitación el participante podrá utilizar eficientemente las herramientas y técnicas para una efectiva gestión de riesgos de mercado y liquidez, así como analizar las diversas propuestas metodológicas para la gestión de riesgo de mercado asociadas a la gestión estructural de balance y ampliar los conocimientos para el desarrollo de modelos y metodologías aplicables para la gestión de activos y pasivos (ALM). Finalmente, se dará a conocer las prácticas en el análisis de los riesgos de liquidez para entidades bancarias y proveer los factores de evaluación para la medición de estos.

### **TEMARIO:**

#### **Riesgo de Mercado**

- Definición y objetivos del riesgo de mercado, normatividad vigente
- Actividades sujetas a riesgo de mercado
- Tipo y factores de riesgo de mercado
- Introducción a las medidas de riesgo de mercado y modelos de volatilidad y correlación

#### **Riesgo Cambiario**

- Definición riesgo cambiario y normatividad vigente para la gestión de riesgo cambiario.
- Modelos VaR Paramétrico, Simulación Histórica y Simulación de Montecarlo.
- Requerimientos patrimoniales por riesgo cambiario

#### **Riesgo de Liquidez**

- Definición riesgo de liquidez y normatividad vigente para la gestión de riesgo de liquidez
- Metodologías de evaluación para el riesgo de liquidez
- Cuadros de liquidez por plazos de vencimiento
- Plan de contingencia de liquidez
- Modelamiento de pronóstico para los ratios de liquidez en M.N. y M.E.

### **DURACION:**