



**Bolsa de
Valores**
de Asunción

Curso:
Gestión de
Riesgos Financieros

¿A quiénes va dirigido?



Este curso está dirigido a egresados o estudiantes de últimos años de las carreras universitarias y a profesionales que deseen conocer y comprender los métodos de estimación del riesgo mercado, asumido por una cartera.



OBJETIVOS

- 01** Conocer los métodos de estimación del riesgo mercado
- 02** Manejar las gestiones de riesgos

- 03** Identificar los riesgos de mercados
- 04** Aplicar un análisis de gestión de riesgos.

CONTENIDO

TEMA I: INTRODUCCIÓN A LA GESTIÓN DE RIESGO

- ¿Qué es el riesgo?
- Riesgos que enfrentan las empresas
- Gestión de Riesgos Financieros
- ¿Qué es VaR?
- Tipos de VaR

TEMA II: CONCEPTOS ESTADÍSTICOS

- Estadística discreta, estimando retornos, estimando volatilidades, estimando matrices de varianzas y covarianzas.
- Distribución normal
- Duración
- PV01

TEMA III:

- VaR paramétrico
- VaR por simulación Histórica
- VaR por monte carlo: metodología, inputs, medición de riesgos (individual y de portafolio)
- Stress Testing VaR
- Análisis de escenarios
- VaR Marginal y VaR Condicional
- Backtesting VaR

TEMA IV: CASOS PRÁCTICOS

- VaR paramétrico
- VaR por simulación histórica
- VaR por Simulación de monte Carlo: VaR de FX PYG, VaR de un portafolio de acciones, VaR de un portafolio de bonos, análisis de escenarios y VaR Stress



CERTIFICACIÓN

Para acceder a la certificación por parte de la Bolsa de Valores y Productos de Asunción S.A, los participantes del presente curso deberán cumplir con la asistencia mínima del 80 % en las sesiones.





INVERSIÓN

Gs. 340.000

Podes realizar tu pago desde la web:
campus.bolsadevalores.com.py
mediante tu tarjeta de débito/crédito

PAGO SEGURO



Más información:



+595982753007



CURSOS@BOLSADEVALORES.COM.PY



¿Cómo llegar a la **Bolsa de Valores de Asunción**?



American School
of Asunción

Avda. España

Avda. España

Prof. Rómulo Feliciángeli

Avda. España

Gonzalo Bulnes

Malutin

Paseo
Carmelitas

Bolsa de Valores de Asunción



Gonzalo Bulnes 830 esq.
Avda. España.





Bolsa de
Valores
de Asunción

campus.bolsadevalores.com.py