

# Riesgo de Mercado y Balance



La formación perfecta para dominar el riesgo de mercado y convertir análisis, métricas y coberturas en decisiones que protegen y potencian el crecimiento de tu entidad

*Este programa te brinda las herramientas clave para entender cómo se comportan los mercados, medir con precisión el riesgo en distintos activos y aplicar estrategias efectivas de gestión y cobertura. A través de métodos prácticos y modelos actuales, aprenderás a tomar decisiones informadas, optimizar la exposición al riesgo y alinear la gestión con las exigencias regulatorias del sector financiero.*



**DURACIÓN**  
2 meses



**MODALIDAD**  
Híbrida



**ENFOQUE**  
100% práctico



**DEDICACIÓN**  
40h

## Programa

### 1. Riesgo de Mercado y Contrapartida

1. Productos y mercados financieros
2. Riesgo de mercado:
  - a. Medición del R. de Mercado
  - b. Los modelos de R. Mercado
  - c. Stress Testing
  - d. Gestión del R. de Mercado
3. Riesgo de contrapartida
  - a. Medición del riesgo de contrapartida
  - b. Capital por riesgo de crédito
4. Regulación

### 2. Riesgo de Balance / Estructural

1. Introducción a los riesgos estructurales y gestión financiera
2. Riesgo de liquidez en balance
3. Riesgo de tipo de interés en balance
4. Ejercicio práctico: liquidez e interés
5. Lecciones tras políticas de tipos y mala gestión