



SEMINARIO

Riesgos en el Mercado de Valores



Profundizaremos en los riesgos clave asociados al mercado de valores y exploraremos estrategias de gestión desde las perspectivas de los inversionistas y las instituciones.

FACILITADOR



**ANDRES FELIPE
ORTIZ RENGIFO**

Ingeniero financiero, MBA con 18 años de experiencia en el sector financiero.

TEMAS

Introducción

- Riesgos
- Diversificación

Módulo 1: Riesgo de crédito/Incumplimiento/Emisor

- ¿Qué es el riesgo de crédito? Ejemplos.
- Gestión del riesgo desde el lado inversionista y desde el lado de las instituciones.
- Las calificadoras de riesgo.
- Scoring crediticio.
- Indicadores Financieros / Análisis fundamental.
- Coberturas.

Módulo 2: Riesgo de mercado/Tipo de interés/Cambiario

- ¿Qué es el riesgo de mercado? Ejemplos.
- Gestión del riesgo desde el lado inversionista y desde el lado de las instituciones.
- VaR de activos y de un portafolio.
- DVI.
- Duración / Duración modificada.
- Coberturas.

Módulo 3: Riesgo de liquidez

- ¿Qué es el riesgo de liquidez? Ejemplos.
- Causales del riesgo.
- Gestión desde el lado inversionista y desde el lado de las instituciones.

Módulo 4: Otros riesgos asociados al Mercado de Valores.

- **Riesgo país:** ¿Qué es? Ejemplos.
 - Cómo hacer seguimiento.
 - Diversificación.
- **Riesgo reputacional:** ¿Qué es? Ejemplos.
 - Pánico financiero.
 - Sector económico.
 - Referencias.
- **Riesgo de lavado de activos y financiación del terrorismo:** ¿Qué es? Ejemplos.
 - KYC.
 - Estructuras y beneficiarios finales (PN).
 - Tipologías.
 - Jurisdicciones de alto riesgo.
 - Paraísos fiscales.
- **Riesgo operativo:** ¿Qué es? Ejemplos.
 - Confidencialidad.
 - Protección de datos personales.
 - Ciberseguridad.
 - Ejecución de operaciones.



**Marzo
18, 19, 25 y 26
de 2025.**

Horario de clases:
de 6:00 p.m. a 8:00 p.m

Modalidad Virtual.

Inversión:
B/.298.00(miembros)
B/.398.00 (no miembros)
NO COBRAMOS ITBMS.

***Descuento adicional para grupos.**

Incluye certificado de participación.

MAS INFORMACIÓN Y REGISTRO:

info@apamec.org

