



# SEMINARIO ESTRATEGIAS DE COBERTURA Y VALORACIÓN DE DERIVADOS



## CONTENIDO TEMÁTICO

### Módulo 1. COBERTURAS CON DERIVADOS

- Cómo funcionan los forward, futuros, opciones y swaps.
- Cómo se establecen los precios forward.

### Módulo 3. VALORACIÓN DE DERIVADOS

- Metodologías de valoración de forwards, opciones y swaps.
- Valoración de derivados exóticos: opciones americanas, straddles, collares.
- Instrumentos compuestos.

### Módulo 2. DERIVADOS IMPLÍCITOS BAJO NIIF 9

- Qué es un derivado implícito.
- Cómo se identifican los derivados implícitos.
- Diferencias entre los derivados implícitos y los contratos onerosos bajo NIIF.

### Módulo 4. AJUSTE AL VALOR RAZONABLE POR RIESGO DE CRÉDITO

- CVA y DVA.