

WORKSHOP

GERENCIAMIENTO DE RIESGOS EN LA COMERCIALIZACIÓN DEL CAFÉ: FIJACIONES, MANEJO DE INSTRUMENTOS DE PROTECCIÓN Y ANÁLISIS EN LOS MERCADOS A FUTURO Y OPCIONES: 3, 4 Y 5 DE JULIO 2024

OBJETIVO

Proporcionar la visión y herramientas para un Gerenciamiento Profesional de Riesgos en el mercado del Café en un contexto internacional cambiante de desglobalización y afectación de variables.

TEMARIO DEL CURSO

- I. Aspectos macroeconómicos de los mercados bursátiles y su interrelación con otros mercados. Influencia de variables externas. visualización práctica.
- II. Funcionamiento del mercado del café en la Bolsa. ICE New York Coffee
 - a. El contrato de café en Bolsa
 - b. Participantes: orígenes, Importadores y Fondos, como se mueven
 - c. Teoría del precio, volumen e interés abierto. Interrelación entre ellos.
 - d. Fundamentales vs técnicos. Incoherencias y exageraciones de los mercados. Teoría del movimiento aleatorio y Sistemas automatizados de trading
 - e. El commitment of Traders Report
 - f. El trading, márgenes y funcionamiento
 - g. El Spread, switches
 - h. Incumplimientos y Washouts
- III. EL nexo con los físicos: La cobertura de precios
 - a. Definición de una cobertura vía futuros
 - b. La cobertura de un FTO, FT y convencionales.
 - c. La operación "Contra Físicos" AAs (Against actuals) o EFP (Exchange for physicals)
 - d. La cobertura de un productor, un exportador, un importador y un Tostador, Casos y ejemplos.
- IV. Las opciones a futuro, uso como seguros a alza y a la baja
 - a. Definición de una opción call y put. Composición del premio
 - b. Compra de seguros al alza o compra de calls. Utilización. Casos
 - c. Ventas de calls y ventas de Puts. Manejo y gerenciamiento
 - d. Compra de seguros a la baja o Puts. Utilización casos

- e. Otras combinaciones con futuros y opciones
- f. Spread options para disminuir el costo de una cobertura.
- g. La importancia de manejar algoritmos en una matriz de riesgos secuencial para la simulación de diferentes escenarios.

V. Coberturas con opciones en un mercado alcista, estable y bajista.

VI. introducción al análisis técnico y modelos algorítmicos de trading

VII. EXPOSITOR

Víctor F. Góngora Chirinos, economista de la Universidad de Lima, con estudios de Maestría en la Universidad de Nueva York. Trabajo en Merrill Lynch en la ciudad de Nueva York en la división de Mortgage Capital Market. Cuenta con una definida especialización en “Finanzas y en Mercados a Futuros y coberturas” a través de su carrera profesional.

Ha sido miembro del NATIONAL FUTURE ASSOCIATION (NFA) y actualmente es “Introducing Broker” de la prestigiosa firma Straits Financial LLC.

Cuenta con más de 20 años de experiencia en estos mercados y ha dictado a nivel nacional e internacional cursos análogos en diversas instituciones bancarias y escuelas de postgrado como ESAN, Universidades del Perú e instituciones en el Extranjero.

Ha sido invitado como expositor en múltiples conferencias y entrenado traders que actualmente optimizan su gestión a través del buen uso profesional de estos instrumentos en diferentes Empresas Cafetaleras, Mineras Sociedades Agentes de Bolsa locales, etc.

VIII. CONSTANCIA DE PARTICIPACIÓN

Se otorgará constancia a los participantes que cumplan con los siguientes requisitos:

- Ingreso puntual a la clase.
- Permanecer el 100% en la duración del curso.

IX. DURACIÓN Y HORARIO DEL CURSO

- Miércoles 3 de Julio del 2024: 5:00-8:00 pm.
- Jueves 4 de Julio del 2024: 5:00-8:00 pm.
- Viernes 5 de Julio del 2024: 5:00-8:00 pm
- Sabado 6 de Julio del 2024: 10:00 am – 1:00 pm (opcional) Apertura de cuentas, revision de algunos temas

X. COSTO Y FORMA DE PAGO

- El costo por participante: US\$ 300.00.
- Beneficiario: Víctor F. Góngora Chirinos.
- Banco de Crédito del Perú: Número de cuenta ahorros dólares: **194-12460759-1-24**
- Banco de Crédito del Perú: CCI dólares: **002-19411246075912492**
- Remitir vóucher escaneado a: victorgongorach@msn.com
- Enviar un email de interés el mismo que se incluirá en la ficha de inscripción
- Fecha ultima de cierre de inscripciones y pago: viernes 28 de Junio del 2024

XI. PARTICIPANTES Y LUGAR

- Número máximo de participantes: 10-12 personas.
- El local para este Workshop es las oficinas de la Corporacion CAFÉ PERU. Pichanaqui, Junin que cuenta con acceso a internet y aire acondicionado.

XII. IMPORTANTE

Los participantes al curso deben contar con una laptop o notebook.