



Descriptivo

Riesgo de Mercado con Risk Simulator

Descripción:

Sin importar cuál sea nuestra disciplina de conocimiento o en qué área de trabajo nos desempeñemos, es poco probable que no hayamos siquiera digitado algunos cuantos números en MS Excel; es por esto, que en esta oportunidad se realizará una aplicación de las herramientas de Risk Simulator como un Add in de Excel, para analizar la gestión de riesgo, la medición del VaR y CvaR para la toma de decisiones.



Dirigido a:

Profesionales, docentes, investigadores, estudiantes y en general a todas las personas que trabajen o estén interesadas en aprender/repasar las principales funcionalidades de uno de los programas más versátiles para el análisis de información cuantitativa y riesgos: Risk Simulator



Objetivo:

- Realizar una introducción a la gestión del riesgo de mercado haciendo uso de la herramienta Risk Simulator.
- Revisar las principales funcionalidades de Risk Simulator para el análisis cuantitativo de información: gestión de bases de datos, formulación, análisis descriptivo e inferencial, y automatización.
- Repasar, cuando sea necesario, los aspectos conceptuales relevantes para entender la aplicación de una herramienta. (Por ejemplo: ¿cómo interpretar la tabla de resultados obtenidos en un ejercicio de regresión?)



Temario:

Introducción a la gestión de riesgos

- Uso de Risk Simulator para el cálculo del VaR y CVaR como indicadores de riesgo de mercado.
- Presentación de los diferentes módulos del software.
- Ejercicio práctico.
- Interpretación de los resultados.



Instructores: