



Descriptivo

# Riesgo de Mercado y Valores Extremos

## Descripción:

La presentación se apoya con un ejemplo práctico en el cual se expondrán las herramientas presentes en el Software Risk Simulator para medir el riesgo de mercado.

### Dirigido a:

Este taller está dirigido a profesionales y estudiantes del área financiera, interesados en la gestión del riesgo financiero.

### Objetivo:

Se analizará el procedimiento para la medición del riesgo de mercado y se aplicará el modelo de Valores Extremos a través del uso de Risk Simulator.

### Temario:

1. Qué es Riesgo
2. Tipos de Riesgo
3. Riesgo de Mercado
4. El Valor en Riesgo EL CVaR
5. Análisis de la Teoría de Valores Extremos
6. Aplicaciones con Risk Simulator

### Instructores:

#### **Brayan Ricardo Rojas**

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo Cuantitativo - CQRM, impartido por el Dr. Johnathan Mun y otorgado por el Instituto IIPER. Certificado como Financial Risk Manager (FRM) por la Global Association of Risk Professionals. Economista con Maestría en Finanzas y Especialista en Riesgos Financieros con experiencia de más de siete años en su mayoría en las principales instituciones financieras de Colombia y con experiencia internacional en la banca Panameña. Amplios conocimientos en riesgos de mercado, liquidez, crédito y contraparte, así como en valoración de productos financieros y derivados. Amplias habilidades econométricas aplicadas a la gestión del riesgo y en la implementación de requerimientos normativos. Passed CFA Level I.