

# Webcast

## Taller Didáctico Vía Web - Gestión del Riesgo de Mercado: Conceptualización y aplicación de la Simulación Monte Carlo - Risk Simulator

### Descripción

El taller virtual desarrollará en primer lugar, el marco conceptual que abarca a la gestión de los riesgos financieros, y en particular se tratará el tema del riesgo de mercado, explicando los factores necesarios para su análisis (definiciones previas). Asimismo, se explicará el proceso de la simulación Monte Carlo y su importancia en la valoración de los riesgos financieros. Luego de ello, se presentará una visión general del software Risk Simulator, como herramienta en la gestión de riesgo de mercado, caracterizándolo mediante un ejemplo práctico aplicado a un conjunto de acciones.

### Dirigido a

Profesionales vinculados en la administración del riesgo y la incertidumbre en la toma de decisiones. Directores, gerentes, profesionales vinculados a departamentos de riesgo y docentes.

### Objetivo

- La capacidad de utilizar Risk Simulator como herramienta para desarrollar experimentos de Monte Carlo para la gestión del riesgo de mercado. - Habilidades y destrezas en la aplicación de la Simulación de Monte Carlo en los modelos de valoración de riesgos.

### Temario

El taller virtual comprenderá el desarrollo de los siguientes temas:

#### Definiciones Previas

Introducción Análisis estadístico: Medición de la incertidumbre Definición e importancia de la gestión del riesgo

Tipos de riesgos

Gestión del riesgo de mercado

Definición del Value at Risk y Conditional Value at Risk

#### Risk Simulator como herramienta en la gestión del riesgo

Descripción del Software Risk Simulator

Determinación de variables supuestos individuales y correlacionados

Determinación de variables pronóstico Estructuración de un experimento

#### Ejemplo práctico aplicado a un conjunto de acciones

### Instructores

#### Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.

Economista, con especialización en gestión de riesgos financieros y maestría en finanzas. Cuenta con más de 10 años de experiencia en la industria bancaria, financiera y de consultoría. Actualmente, es el Director de

Riesgos Financieros en KPMG Colombia, en donde lidera procesos de implementación de gestión de riesgos, analítica de datos y machine learning en diferentes sectores e industrias para entidades públicas y privadas. Es profesor de cursos de posgrado en diferentes instituciones como la Universidad del Rosario, EAFIT y el Politécnico Grancolombiano. Además, hace parte del equipo de instructores del área cuantitativa de Software Shop, en donde trabaja con diferentes herramientas para el análisis estadístico y econométrico.

## Información General

### Duración

40 minutos

### Fecha de Inicio

Vie. 15 de Abr de 2011

### Horarios

San José de Costa Rica 8:00 a.m

México D.F. 9:00 a.m

Bogotá 9:00 a.m

Quito 9:00 a.m

Lima 9:00 a.m.

Caracas 9:30 a.m

Bolivia 10:00 a.m

Santiago 10:00 a.m

Buenos Aires 11:00 p.m

### Herramientas de apoyo



### Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora