Webcast

Taller didáctico vía web: Medición del Riesgo de Mercado con Risk Simulator

Descripción

Por medio de la presentación vía web gratuita se presentará la importancia de la medición del riesgo de mercado y como por medio del software Risk Simulator 2012 podrá calcular el valor en riesgo para un portafolio de renta variable así como el conditional VaR o Expected Shortfall utilizando la metodología de Monte Carlo finalmente se presentará una variación de la metodología paramétrica por medio de modelación de la volatilidad usando un modelo EWMA permitiendo mejorar en la cuantificación del riesgo.

Dirigido a

Dirigido a estudiantes y profesionales que deseen utilizar las aplicaciones avanzadas que ofrece Risk Simulator para la gestión del riesgo de operativo.

Objetivo

Se expondrá de una manera sencilla los temas teóricos y sin extenderse en los detalles de complicados modelos matemáticos.

Temario

Qué es Riesgo de Mercado?
Importancia de la medición del Riesgo de Mercado
Metodologías en la medición del Riesgo de Mercado
Cálculo del VaR y ES por Monte Carlo
Implementación del EWMA en la medición del VaR
Conclusiones
Sesión de preguntas

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
1 hora

Fecha de Inicio
Vie. 28 de Sep de 2012

Horarios
San José de Costa Rica 10:00 a.m
México D.F. 11:00 a.m
Bogotá 11:00 a.m.
Quito 11:00 a.m
Lima 11:00 a.m.
Caracas 11:30 a.m
Bolivia 12:00 m.
Santiago 1:00 p.m
Buenos Aires 1:00 p.m

Herramientas de apoyo
Risk Simulator

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