

## Webcast

Medición del Riesgo de Mercado en Bancos en Chile con Risk Simulator en períodos de alta volatilidad.

### Descripción

Considerando la normativa vigente de los organismos fiscalizadores sobre la evaluación del riesgo de mercado para los bancos en Chile sumado a la alta volatilidad que presentan hoy en día los instrumentos financieros de renta variable, ésta presentación busca exponer de una manera sencilla los temas teóricos sin extenderse en los detalles de complicados modelos matemáticos para la medición del riesgo de mercado en forma mejorada, obteniendo pronósticos más robustos a través de un software especializado. Se presentará el software Risk Simulator, su pertinencia en la medición del riesgo de mercado y como por medio de la herramienta se podrá calcular el valor en riesgo para un portafolio de renta variable, así como el conditional VaR o Expected Shortfall y pruebas de tensión o Stresstesting utilizando la metodología de Monte Carlo.

### Dirigido a

Profesionales y personas interesadas que deseen utilizar las aplicaciones avanzadas que ofrece Risk Simulator para la gestión del riesgo de mercado en los bancos en Chile y/o en otros países en donde la normativa sea similar.

### Objetivo

- Dar a conocer las nociones conceptuales básicas de la gestión del riesgo de mercado bajo condiciones de alta volatilidad. - Revisar en general la normativa vigente emitida por los organismos fiscalizadores en Chile para la industria bancaria y su aplicación por los entes regulados. - La capacidad de utilizar Risk Simulator como robusta y sencilla herramienta para hacer mediciones del riesgo de mercado en condiciones de inestabilidad de los precios de los portafolios de instrumentos financieros.

### Temario

- ¿Qué es Riesgo de Mercado?
- Importancia de la medición del Riesgo de Mercado.
- Metodologías en la medición del Riesgo de Mercado.
- Normativa vigente de la SBIF y aplicación por las entidades fiscalizadas.
- Cálculo del VaR y CVaR por Monte Carlo.
- Pruebas de Stresstesting.
- Conclusiones.
- Sesión de preguntas.

### Instructores

Patricio Venegas

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CRM, impartido por el Dr. Johnathan Mun y otorgado por el Instituto IIPER. Profesional de la carrera de Ingeniería Comercial de la Universidad Santiago de Chile, con un MBA en Gestión de Finanzas, Magister en Administración de la Universidad de Chile. Actualmente trabaja como académico universitario y consultor independiente en el área de Finanzas en Santiago de Chile..

## Información General

### Duración

1 hora

### Fecha de Inicio

Jue. 06 de Mar de 2014

### Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m

México D.F. 10:00 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



### 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