

## Webcast

### Teoría del Valor Extremo y su Aplicación en Riesgos de Mercado

#### Descripción

Este taller aborda desde un enfoque sencillo y práctico el análisis de riesgo en un portafolio de inversión, terminando con un análisis de pruebas de estrés a través de modelación de escenarios extremos.

#### Dirigido a

Este taller está dirigido a Profesionales, Consultores y Docentes interesados en temas de Modelación de Riesgo de Mercado que deseen obtener resultados avanzados en términos Estadísticos y Financieros a fin de garantizar confiabilidad desde el punto de vista de las estimaciones.

#### Objetivo

Llevar a los participantes por las principales metodologías teóricas para una correcta aplicación de la Modelación de Riesgo de Mercado.

#### Temario

##### Teoría del Valor Extremo

- Valuación de instrumentos de renta variable
  - Factores de riesgo
  - Portafolios de Inversión y el efecto diversificación.
1. Capital Asset Pricing Model (CAPM)
  2. Cálculo de VaR: Simulación Montecarl
- Stress Testing
1. Análisis a través de Teoría del Valor Extremo

#### Instructores

Fernando Jáuregui Puertas

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos CRM, impartida con el Dr. Jonathan Mun. Profesional en Ciencias Económicas de la Universidad Nacional de Ingeniería del Perú. Executive Master in Financial Analysis en la Universidad Carlos III de Madrid (España). Adicionalmente, cuenta con especialización en Gestión de Riesgos Financieros en BURSEN (Centro de Estudios Bursátiles de la Bolsa de Valores de Lima) y en Formulación y Evaluación de Proyectos de Inversión Pública en la Universidad ESAN. Actualmente es docente de la Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico (Perú) e instructor de SOFTWARE shop para LATAM. Tiene experiencia en el sector público como Analista de Proyectos de Inversión y en el Sector Bancario como Analista de Estudios Económicos. Anteriormente se desempeñó como docente de la Facultad de Ingeniería Económica de la Universidad Nacional de Ingeniería (Perú), en las asignaturas de Econometría II y Análisis de Series Temporales.

## Información General

#### Duración

1 Hora

#### Fecha de Inicio

Mie. 12 de Nov de 2014

#### Horarios

San José de Costa Rica 2:00 p.m México D.F. 2:00 p.m Bogotá 3:00 p.m Quito 3:00 p.m Lima 3:00 p.m Caracas 3:30 p.m Bolivia 4:00

pm Buenos Aires 5:00 p.m Santiago 5:00 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