Webcast

Verificación y Calibración de los Modelos de Riesgo de Mercado-Prueba de Kupiec

Descripción

El taller virtual tiene como propósito estimar dos metodologías de medición de riesgo de mercado (Simulación histórica y simulación Monte Carlo) a partir de Risk Simulator, para luego desarrollar una prueba que determine la validez de las metodologías y su contribución para encontrar la pérdida esperada que debe minimizar una institución financiera.

Dirigido a

El evento está dirigido a estudiantes y profesionales que deseen utilizar la prueba de Kupiec para verificar la validez del modelo de riesgo de mercado desarrollado a través del software Risk Simulator.

Objetivo

Desarrollar dos tipos de metodologías para estimar el valor en riesgo de un activo de renta variable a partir del software Risk Simulator. Estimar la validez estadística de las metodologías desarrolladas para la medición de riesgo de mercado.

Temario

P**rueba de Kupiec**

- ¿Qué es el riesgo de mercado?
- Metodologías en la medición del riesgo de mercado.
- Implementación de la metodología simulación de Monte Carlo para la medición del VaR con Risk Simulator.
- Implementación de la metodología no paramétrica para la medición del VaR
- Cociente de fallas
- Proporción log-Probabilística
- Elección de la metodología para la medición de riesgo de mercado.

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analitica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Información General

Duración
1 Hora

Fecha de Inicio
Vie. 27 de Nov de 2015

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
Buenos Aires 1:00 p.m
Santiago 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