

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

Prueba 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 de Colombia, con Maestría en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid - España y Certificación Internacional en Gestión Cuantitativa de Riesgo Cuantitativos (CQRM) otorgada por el Instituto IIPER (International Institute of Professional Education and Research). Instructor del Portafolio de Riesgo de Software Shop para Latinoamérica, se ha desempeñado como docente de Estadística, Toma de Decisiones y Econometría Financiera en Especialización y Maestría en diferentes universidades de Colombia.

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



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