

Webcast

Riesgo de Mercado con Risk Simulator

Descripción

Sin importar cuál sea nuestra disciplina de conocimiento o en qué área de trabajo nos desempeñemos, es poco probable que no hayamos siquiera digitado algunos cuantos números en MS Excel; es por esto, que en esta oportunidad se realizará una aplicación de las herramientas de Risk Simulator como un Add in de Excel, para analizar la gestión de riesgo, la medición del VaR y CvaR para la toma de decisiones.

Dirigido a

Profesionales, docentes, investigadores, estudiantes y en general a todas las personas que trabajen o estén interesadas en aprender/repasar las principales funcionalidades de uno de los programas más versátiles para el análisis de información cuantitativa y riesgos: Risk Simulator

Objetivo

- Realizar una introducción a la gestión del riesgo de mercado haciendo uso de la herramienta Risk Simulator.
- Revisar las principales funcionalidades de Risk Simulator para el análisis cuantitativo de información: gestión de bases de datos, formulación, análisis descriptivo e inferencial, y automatización.
- Repasar, cuando sea necesario, los aspectos conceptuales relevantes para entender la aplicación de una herramienta. (Por ejemplo: ¿cómo interpretar la tabla de resultados obtenidos en un ejercicio de regresión?)

Temario

Introducción a la gestión de riesgos

- Uso de Risk Simulator para el cálculo del VaR y CVaR como indicadores de riesgo de mercado.
- Presentación de los diferentes módulos del software.
- Ejercicio práctico.
- Interpretación de los resultados.

Instructores

Andrés Raúl Cruz Hernández

Instructor del portafolio cuantitativo en Software Shop, profesional en Finanzas y Comercio Internacional, Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos Cuantitativos CQRM, otorgada por el Instituto IIPER. Actualmente adelanta estudios de Doctorado en Administración en la Universidad de los Andes en Colombia. Cuenta con experiencia en activos de renta variable y gestión de riesgos así como amplio conocimiento en temas relacionados con el análisis estadístico económico y financiero del mercado real y bursatil así como en valoración de activos y portafolios de inversión con apoyo de herramientas especializadas como Risk Simulator, Optifolio y Stata.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Lun. 29 de Feb de 2016

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