

Webcast

Sesión II : Modelación de Riesgos Financieros

Descripción

Este taller que se divide en tres sesiones abarcará los fundamentos básicos para la modelación de riesgos financieros, estos fundamentos son la base para la cuantificación de riesgos. Durante las tres sesiones se desarrollarán ejercicios que abarquen tópicos de estadística descriptiva, estadística inferencial y finanzas aplicado a la modelación de riesgos financieros.

Dirigido a

Profesionales, investigadores, docentes, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en aprender conceptos básicos de los métodos cuantitativos para la modelación de riesgos financieros.

Objetivo

Diferenciar entre riesgo e incertidumbre. Mostrar el desarrollo de procedimientos estadísticos para la cuantificación de riesgos. Aplicar métodos cuantitativos que involucren la simulación de Monte Carlo en la modelación de riesgo de mercado y riesgo operacional. Usar el Simulador de Riesgo como oportunidad para generar eficiencia en los procesos de medición de riesgos financieros.

Temario

- Introducción al Análisis de Riesgo
- Ejercicios de Estadística Descriptiva (Medidas de tendencia central, variación, sesgo y apuntalamiento)
- Ejercicios Distribución de Probabilidad (Distribución Normal y Poisson)
- Uso del Simulador de Riesgo para hacer análisis descriptivo de la información
- Caso aplicado de Riesgo de Mercado para un activo de renta variables
- Caso aplicado para Riesgo Operativo con ajuste de distribución

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

Jue. 25 de Ago de 2016

Horarios

San José de Costa Rica 9:00 a.m

México D.F. 10:00 a.m

Bogotá 10:00 a.m

Quito 10:00 a.m

Lima 10:00 a.m

Caracas 10:30 a.m

Bolivia 11:00 a.m
Buenos Aires 12:00 m
Santiago 12:00 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