

# Webcast

## Sesión III: 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 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 analítica 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

Jue. 01 de Sep 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.

Herramientas de apoyo



## 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