

Taller

Taller Presencial: Modelado de Riesgos Financieros a partir del uso de Métodos Cuantitativos

Descripción

Este taller abarcará los fundamentos necesarios para el modelado de riesgos financieros. Durante la sesión se desarrollarán ejercicios aplicados al modelado de riesgos financieros que involucran tópicos de estadística descriptiva, estadística inferencial y finanzas.

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

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

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal

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 y 30 Minutos

Fecha de Inicio

Vie. 12 de May de 2017

Horarios

De:

3:00 pm a 4:30 pm

Fecha:

Viernes, 12 de Mayo de 2017

Lugar:

Fundación Universitaria CEIPA

Dirección:

Calle 77 sur # 40-165 Vereda San José , Sabaneta
Piso 5, Torre Académica, Laboratorio Financiero

Ciudad

Medellín (Antioquia, Colombia)

Lugar:

FUNDACIÓN UNIVERSITARIA CEIPA

Herramientas de apoyo



Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

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