Webcast

Gestión de 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 cuántos 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 de mercado por medio del cálculo del VaR y otros indicadores orientados a mejorar la eficiencia en 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

- Presentar 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.

Temario

- Introducción a la gestión de riesgos
- Uso de Risk Simulator para el cálculo del VaR como indicador de riesgo de mercado.
- Presentación de los diferentes módulos del software.
- Ejercicio práctico.
- Interpretación de los resultados.

Instructores

Andrés Raúl Cruz Hernández

Profesional en Finanzas y Comercio Internacional de la Universidad de La Salle. Magíster en Investigación en Administración (énfasis en finanzas) y Doctor en Administración de la Universidad de los Andes. Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos Cuantitativos CQRM. Actualmente es profesor de la Escuela de Negocios del Tecnológico de Monterrey y hace parte de nuestro grupo de especialistas certificados Next-Gen.

Información General

Duración
1 Hora

Fecha de Inicio
Jue. 17 de Ago de 2017

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 11:00 a.m
Bolivia 11:00 a.m
Buenos Aires 12:00 m
Santiago 1:00 p.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