Webcast

Sesión II: Metodologías para calcular el Valor en Riesgo (VaR) en Riesgo de Mercado

Descripción

En este segundo webinar, se trabajará la metodología de Simulación Histórica, estimación del cociente de fallas, y finalmente el Conditional VaR.

Dirigido a

El evento está dirigido a estudiantes y profesionales que deseen utilizar MS.Excel y Risk Simulator para calcular el Valor en Riesgo en riesgo de mercado con las tres metodologías que existen como también validar cuál de estas metodologías sería la más adecuada.

Objetivo

- Mostrar las tres metodologías para estimar el Valor en Riesgo de un activo de renta variable a partir del software Risk Simulator.
- Estimar la validez estadística de las metodologías desarrolladas para la medición de riesgo de mercado.
- Utilizar Risk Simulator como herramienta para estimar las diferentes maneras de calcular la volatilidad.

Temario

1. ¿Qué es el riesgo de mercado?

2.Metodologías en la medición del riesgo de mercado.

- Paramétrico
- Simulación Histórica
- Simulación de Monte Carlo

3. Cociente de fallas

4. Proporción log-Probabilística

5. Elección de la metodología para la medición de riesgo de mercado.

6 Técnicas para calcular volatilidad

- Histórica
- Dinámica
- Condicional

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 analitica 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

45 Minutos

Fecha de Inicio

Vie. 29 de Sep de 2017

Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m
México D.F. 11:00 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

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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