

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, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle, Magíster en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España y acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartida por el Dr. Johnathan Mun y otorgada por el Instituto IIPER. Actualmente, es consultor y docente en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) , además, se ha desempeñado como docente y director de tesis de maestría en diferentes universidades de la región así como expositor internacional e instructor especializado en temas de riesgo y finanzas como parte del equipo de instructores de Software Shop para Latinoamérica.

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



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