

Taller

Taller Practico Online en Uso de Software Risk Simulator FORUM

Descripción

Por medio de la presentación vía web gratuita se presentará la importancia de la medición del riesgo de mercado y como por medio del software Risk Simulator 2012 podrá calcular el valor en riesgo para un portafolio de renta variable así como el conditional VaR o Expected Shortfall utilizando la metodología de Monte Carlo finalmente se presentará una variación de la metodología paramétrica por medio de modelación de la volatilidad usando un modelo EWMA permitiendo mejorar en la cuantificación del riesgo.

Dirigido a

Dirigido a estudiantes y profesionales que deseen utilizar las aplicaciones avanzadas que ofrece Risk Simulator para la gestión del riesgo de operativo.

Objetivo

Se expondrá de una manera sencilla los temas teóricos y sin extenderse en los detalles de complicados modelos matemáticos.

Temario

Qué es Riesgo de Mercado?
Importancia de la medición del Riesgo de Mercado
Metodologías en la medición del Riesgo de Mercado
Cálculo del VaR y ES por Monte Carlo
Implementación del EWMA en la medición del VaR
Conclusiones
Sesión de preguntas

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

2 horas

Fecha de Inicio

Lun. 30 de Abr de 2018

Horarios

Ciudad

Bogotá (Bogotá, Colombia)

Lugar:

Universidad de La Sabana

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