

Webcast

Análisis de Stress en Carteras de Inversión

Descripción

En este webcast se presentará, mediante un ejercicio práctico, la metodología para evaluar análisis de escenarios y pruebas de sensibilidad (Stress Testing) mediante los indicadores de rentabilidad de carteras de inversión y los procedimientos necesarios para realizarlo con apoyo de Microsoft Excel y Risk simulator.

Dirigido a

Estudiantes universitarios, analistas financieros, matemáticos, actuarios, ingenieros, economistas y en general aquellas personas interesadas en el diseño de modelos financieros basados en riesgo.

Objetivo

Conocer los conceptos y procedimientos necesarios para realizar un análisis de stress en carteras de inversión con apoyo de Microsoft Excel y Risk Simulator.

Temario

- Importancia del análisis de Stress.
- Metodología Stress Testing.
- Asignación del peor de los escenarios: Percentil y Simulación Monte Carlo.
- Ejemplo Aplicado de Stress testing a las carteras de inversión.

Instructores

José Daniel Orellana López

Ingeniero financiero de la Universidad Piloto de Colombia, operador Bloomberg con interés en temas de comercio electrónico y uso de plataformas digitales. Actualmente se desempeña como instructor especializado del portafolio cuantitativo en Software Shop con énfasis en análisis de riesgo.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Jue. 31 de May de 2018

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 12:00 m

Bolivia 12:00 m

Santiago 12:00 m

Buenos Aires 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