Webcast

Análisis de Riesgo Aplicado

Descripción

Presentación vía web donde se mostrará cómo realizar Simulación de escenarios a partir del Método Monte Carlo, dando a conocer su funcionalidad y describiendo todos los supuestos a priori de la simulación. A partir de los resultados obtenidos, se podrá interpretar de manera estadística y práctica problemas complejos.

Dirigido a

Gerentes financieros y de riesgos, analistas financieros, consultores, docentes, investigadores, estudiantes de disciplinas financieras, económicas e ingenierías, especialistas en finanzas, y en general aquellas personas interesadas en conocer los conceptos, aplicaciones y metodologías más relevantes para el análisis de riesgos.

Objetivo

- Aplicar los conceptos teóricos de estadística para la cuantificación de riesgos.
- Analizar y comprender las principales herramientas analíticas para el análisis y gestión de riesgos.
- Interpretar los resultados de la Simulación de Monte Carlo para la toma de decisiones.

Temario

- 1. Introducción a la generación de números aleatorios.
- 2. Creación de perfil, variables de supuesto y pronóstico.
- 3. Simulación de Monte Carlos y correlación por cópulas elípticas.
- 4. Interpretación de resultados.
- 5. Método Bootstrap para la inferencia de resultados estadísticos.

Instructores

Franco Andrés Mansilla Ibañez

Especialista en entrega de soluciones analíticas a necesidades y problemáticas del negocio, tal como inversiones, operaciones y riesgos. Académico de la Universidad de Chile en cursos de Riesgo Financiero del Magíster en Finanzas y Métodos Cuantitativo en la gestión de riesgo en el diplomado de Administración de Riesgo. Sus temas de investigación son: eficiencia de mercado, riesgo financiero, machine learning y econometría.

Información General

Duración

Fecha de Inicio

Vie. 28 de Sep de 2018

Horarios

08:00 a.m San José de Costa Rica 09:00 a.m CDMX - Bogotá - Quito - Lima 10:00 a.m La Paz - Caracas 11:00 a.m Buenos Aires - Santiago de Chile



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