

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

Ingeniero Civil Industrial con Magister en Finanzas en la Universidad de Chile. Actualmente, se encuentra trabajando como Analista Gestión de Riesgo Senior del Banco Santander en Chile. Se ha desempeñado como Analista en Investigación Económica y Financiera para académicos de la Universidad de Chile y Banco Central de Chile en temas de Mercados de Capitales, Eficiencia de Mercado, Riesgo Financiero, Econometría y Estadística. En el área académica ha sido catedrático en temas como: Probabilidad y Estadística, Econometría Financiera, Formulación y Evaluación de Proyecto, y en ramas de ingeniería como Investigación de Operaciones y Taller de Ingeniería Civil Industrial.

Información General

Duración

1 Hora

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