

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

Wilmer Ramírez

Ingeniero financiero de la Universidad Piloto de Colombia, acreditado con la Certificación Internacional en Administración Cuantitativa de Riesgos CQRM, con formación en Bloomberg, auditoría interna ISO 9001, NIC (Normas Internacionales de Contabilidad) y NIIF (Normas Internacionales de Información Financiera). Cuenta con experiencia en solución de problemas en áreas administrativas, contables y financieras en empresas del sector real y estatal. Actualmente se desempeña como instructor especializado del área de Riesgo y Finanzas en Software Shop

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Vie. 23 de Nov de 2018

Horarios

10:00 a.m San José de Costa Rica - CDMX

11:00 a.m Bogotá - Quito - Lima

12:00 a.m La Paz - Caracas

01:00 p.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