

CFU

Conferencias: Marco de apetito al riesgo - Dependencia y correlación en mercados financieros

Descripción

Nuestros conferencistas invitados abordarán dos temáticas fundamentales para la toma de decisiones estratégicas en las organizaciones: **El apetito de riesgo** como un elemento esencial en establecimiento de un sistema de gestión de riesgos y el **Cálculo de la dependencia y correlación en los mercados financieros.**

Dirigido a

Profesionales en las áreas financieras, economía, ingeniería, de riesgo y alta gerencia en entidades no financieras, financieras y del sector real; docentes y profesionales interesados en conocer y aplicar métodos de **análisis cuantitativo** en finanzas y riesgo.

Objetivo

Presentar a los asistentes dos temas importantes en el **análisis de riesgo y finanzas** y dar a conocer conceptos y procedimientos fundamentales para la toma de decisiones estratégicas en las organizaciones.

Temario

Temas a tratar

1. Marco de Apetito al Riesgo

El apetito de riesgo es un elemento esencial que permite a una empresa contrastar los riesgos que afronta con el nivel de riesgos que desea asumir. Para ello, es esencial definir y calcular los riesgos, establecer los roles y responsabilidades de la Alta Gerencia, así como conocer los recursos requeridos para mitigar sus posibles impactos.

2. Cálculo de la Dependencia y la Correlación en Mercados Financieros

Conozca acerca de la validez y pertinencia de utilizar técnicas estadísticas y econométricas para encontrar dependencia y causalidad en variables financieras, cuáles son los principales hechos estilizados sobre rendimientos financieros y cómo mejorar e integrar el análisis de series de tiempo aplicado a Riesgo y Finanzas.

Este evento hace parte de las actividades preámbulo a la
Convención Latinoamericana en Métodos Cuantitativos y Gestión de Riesgo 2019.

Instructores

Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.

Economista, con especialización en gestión de riesgos financieros y maestría en finanzas. Cuenta con más de

10 años de experiencia en la industria bancaria, financiera y de consultoría. Actualmente, es el Director de Riesgos Financieros en KPMG Colombia, en donde lidera procesos de implementación de gestión de riesgos, analítica de datos y machine learning en diferentes sectores e industrias para entidades públicas y privadas. Es profesor de cursos de posgrado en diferentes instituciones como la Universidad del Rosario, EAFIT y el Politécnico Grancolombiano. Además, hace parte del equipo de instructores del área cuantitativa de Software Shop, en donde trabaja con diferentes herramientas para el análisis estadístico y econométrico.

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

4 horas

Fecha de Inicio

Jue. 16 de May de 2019

Horarios

Fechas:

Mayo 16 de 2019

Hora:

2:00 pm a 6:00 pm

Lugar:

Edificio Inst. Mariano Moreno
Av. Calle 127 N. 7a-47 Piso. 4

Herramientas de apoyo

CONVENCIÓN LATINOAMERICANA
EN MÉTODOS CUANTITATIVOS Y GESTIÓN DE RIESGO

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