

Webcast

Medición del Riesgo de Mercado: VaR y simulación de Montecarlo

Descripción

La gestión del riesgo de mercado es clave para optimizar portafolios de inversión en entornos de alta volatilidad. En esta presentación, exploraremos métodos para la medición del Valor en Riesgo (VaR), así como su implementación y análisis, desde enfoques tradicionales hasta técnicas más sofisticadas como la simulación de Montecarlo, lo anterior, con el apoyo de las herramientas de Microsoft Excel y Risk Simulator.

Dirigido a

Analistas de riesgo, profesionales, docentes, estudiantes y público interesado en conocer Excel y Risk Simulator como herramientas de apoyo para la medición y gestión del riesgo de mercado en entornos de alta volatilidad.

Objetivo

Abordar métodos cuantitativos avanzados para la medición del riesgo de mercado y su implementación práctica con herramientas tecnológicas.

Temario

- ¿Qué es el riesgo de mercado?
- Recolección de datos: contexto y explicación.
- Medición del Valor en Riesgo (VaR).
- Simulación Histórica.
- Simulación de Montecarlo.
- Preguntas de los asistentes

Instructores

Thomas Dávila Correa

Experto Técnico Next-Gen, Economista de la Universidad Militar Nueva Granada, con formación complementaria en áreas de educación, contabilidad y sociedad y Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos Cuantitativos (CQRM). Cuenta con experiencia en el análisis y manejo de herramientas informáticas aplicadas a la toma de decisiones en el ámbito de riesgos y finanzas. Su conocimiento abarca el uso de soluciones tecnológicas para la gestión y análisis de datos, lo que le permite apoyar a organizaciones en la toma de decisiones estratégicas basadas en información precisa y actualizada.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Vie. 07 de Feb de 2025

Horarios

10:00 a.m Costa Rica - México

11:00 a.m Colombia - Ecuador- Perú

12:00 a.m Bolivia - Venezuela

13:00 Brasil - Argentina - 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