

Webcast

Taller Didáctico Vía Web - Gestión del Riesgo de Mercado: Conceptualización y aplicación de la Simulación Monte Carlo - Risk Simulator

Descripción

El taller virtual desarrollará en primer lugar, el marco conceptual que abarca a la gestión de los riesgos financieros, y en particular se tratará el tema del riesgo de mercado, explicando los factores necesarios para su análisis (definiciones previas). Asimismo, se explicará el proceso de la simulación Monte Carlo y su importancia en la valoración de los riesgos financieros. Luego de ello, se presentará una visión general del software Risk Simulator, como herramienta en la gestión de riesgo de mercado, caracterizándolo mediante un ejemplo práctico aplicado a un conjunto de acciones.

Dirigido a

Profesionales vinculados en la administración del riesgo y la incertidumbre en la toma de decisiones. Directores, gerentes, profesionales vinculados a departamentos de riesgo y docentes.

Objetivo

- La capacidad de utilizar Risk Simulator como herramienta para desarrollar experimentos de Monte Carlo para la gestión del riesgo de mercado. - Habilidades y destrezas en la aplicación de la Simulación de Monte Carlo en los modelos de valoración de riesgos.

Temario

El taller virtual comprenderá el desarrollo de los siguientes temas:

Definiciones Previas

Introducción Análisis estadístico: Medición de la incertidumbre Definición e importancia de la gestión del riesgo

Tipos de riesgos

Gestión del riesgo de mercado

Definición del Value at Risk y Conditional Value at Risk

Risk Simulator como herramienta en la gestión del riesgo

Descripción del Software Risk Simulator

Determinación de variables supuestos individuales y correlacionados

Determinación de variables pronóstico Estructuración de un experimento

Ejemplo práctico aplicado a un conjunto de acciones

Instructores

Walter Junio Paiva Ramos

Profesional acreditado con las Certificaciones Internacionales en Administración de Riesgos - CRM, impartido por el Dr. Jonhathan Mun (CRM-IIPER) y Certified Risk Analyst (CRA-AAFM). Ingeniero Economista de la

Universidad Nacional de Ingeniería, con Maestría en Matemáticas en la Pontificia Universidad Católica del Perú y estudios de Maestría en Finanzas Corporativas en la Universidad ESAN. Amplia experiencia en el sistema financiero, en temas especializados en Gestión de Riesgos Financieros y Finanzas Bancarias. Tiene en su haber la realización de estudios de investigación en temas relacionados con modelos estadísticos y matemáticos para la Gestión del Riesgo.

Información General

Duración

40 minutos

Fecha de Inicio

Vie. 05 de Mar de 2010

Horarios

Bogotá 11:00am

Caracas 11:30am

San José Costa Rica 10:00am

México D.F. 10:00am

Santiago 1:00pm

Lima 11:00am

Buenos Aires 1:00pm

Herramientas de apoyo



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