

Taller

Taller Didáctico Gratuito Presencial: Introducción a la Gestión del Riesgo de Mercado - Aplicaciones con Risk Simulator - Lima

Descripción

La conferencia abordará desde un enfoque sencillo y práctico la gestión del riesgo de mercado, dando al asistente herramientas básicas que le permitirán trabajar en el mundo del manejo del riesgo con las técnicas más avanzadas; al final se realizará una presentación sobre la herramienta Risk Simulator como opción en la modelación del riesgo y se hará un ejemplos prácticos de la Simulación de Monte Carlo. Risk Simulator es un software ambientado en Microsoft Excel, que permite analizar y evaluar decisiones bajo incertidumbre. Contiene importantes herramientas analíticas que le permiten ampliar su capacidad predictiva para series de tiempo y en general cualquier tipo de información cuantitativa.

Dirigido a

- Llevar al asistente por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico, para que pueda tener una contextualización en el manejo, modelación, medición y administración del riesgo. - Comunicar los conceptos de riesgos y la importancia de contar con una herramienta informática como elemento que permita optimizar las decisiones en la gestión del riesgo. - Desarrollar habilidades en el manejo de Risk Simulator como herramienta en la administración del riesgo y la toma de decisiones.

Objetivo

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.

Temario

1. Definiciones Previas Introducción Análisis estadístico y proceso de Simulación Monte Carlo 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 Métodos de cálculo del VaR
2. Risk Simulator como herramienta en la gestión del riesgo Descripción del Software Risk Simulator Determinación de variables supuestos y variables pronóstico Estructuración de un experimento
3. 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

3 horas

Fecha de Inicio

Mie. 21 de Abr de 2010

Horarios

3:00 p.m. a 6:00 p.m.

Ciudad

Lima (Lima, Perú)

Lugar:

Universidad de Lima

Herramientas de apoyo



Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

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