

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

Instructor de la línea de Riesgo y Finanzas en Software Shop con formación en economía de la Universidad Militar Nueva Granada, participante del grupo de estudios en educación, contabilidad y sociedad, con experiencia en el manejo de herramientas informáticas para el análisis de datos, su aprovechamiento y apoyo en la toma de decisiones.

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

Herramientas de apoyo



Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora