

ecoanálisis

consultores económicos y financieros

TALLER VALOR EN RIESGO

Objetivo General

El objetivo de este taller es el diseño y aplicación de estrategias de inversión y de administración de riesgo de mercado utilizando herramientas de valor en riesgo.

Metodología

La metodología de Valor en Riesgo fue originalmente diseñada para la valoración de riesgo de mercado en portafolios de inversión. En este taller además se exploran especificaciones alternativas para extender el análisis de riesgo de mercado para abarcar el total del estado de resultados e incluir riesgo de liquidez.

Temario del Taller

- **Optimización de portafolios de renta fija basada en valor en riesgo**
- **Aplicación de metodología de Valor en Riesgo por instrumento y factorial**
 - Definición de exposición a factor de riesgo
 - Cálculo de Sensibilidades (DV01)
 - Interpretación de correlaciones
 - Estimaciones paramétricas y no paramétricas
- **Desagregación de riesgo**
 - V@R Marginal
 - V@R por Componente
 - V@R Incremental
- **Metodología de V@R condicional**
- **Stress testing**
 - Ejercicios Estáticos
 - Descomposición de Cholesky
 - Experimentos de Montecarlo
- **Extensión para la inclusión de riesgo de liquidez**
- **Especificación de un modelo simple de Utilidades en Riesgo**

Día: Jueves 13 Agosto
Lugar: Hotel intercontinental
Hora: 8 a.m. a 5 p.m.
Costo:
1 participante: \$500.50
2 part. : 10% desc (\$495.45 c/u)
3 part. o +: 15% desc (\$467.92 c/u)

Incluye Coffee Breaks , Almuerzo y Certificado de Participación

Instructor:
MSc. Pablo Villamichel
Socio Consultor de Ecoanálisis
Experto en Riesgos

Para mayor información :
Raquel Sánchez Quesada
Directora Comercial
ecoanálisis
Oficina: 2291-7600
Cel: 8825-6618
Fax: 2291-7570
raquel@ecoanalisis.org

En este taller se requiere la utilización de una computadora portátil que cuente con Excel instalado.
Los ejercicios que se desarrollarán girarán alrededor de las tasas de interés en colones y dólares, así como tipo de cambio, en Costa Rica.