

## **Curso de Gestión y métodos cuantitativos en Riesgos de Conglomerados**

### **OBJETIVO::**

- Comprender el modelo de gestión de riesgos de conglomerados
- Identificar métodos cuantitativos para gestión los riesgos en Conglomerados
- Aplicar los diferentes métodos cuantitativos a los riesgos de Conglomerados

### **METODOLOGÍA:**

Clases magistrales, acompañadas de talleres, análisis de casos reales y prácticas operativas. Interacción continua del docente con los participantes, desarrollando procesos de permanente retroalimentación

### **CERTIFICADO:**

La asistencia al curso se certifica mediante diploma expedido por Asobursatil y la Bolsa de Valores de Colombia a quienes asistan al 80% de las horas programadas para cada una de las materias.

### **DURACIÓN E INTENSIDAD HORARIA:**

<b>Duración:</b>	<b>20 horas</b>
<b>Horario:</b>	<b>8:00 A 10:00 a.m.</b>
<b>Días:</b>	<b>lunes, miércoles y jueves</b>
<b>Costo por persona:</b>	<b>\$980.000 + IVA</b>
<b>Fecha de iniciación:</b>	<b>Octubre 21 de 2024</b>
<b>Fecha de culminación:</b>	<b>Noviembre 14 de 2024</b>

## CONTENIDO PROGRAMATICO

- . Análisis estadístico de variables aleatorias claves para la identificación de riesgos cuantitativos de Conglomerados.
- Métodos Cuantitativos para la gestión de riesgos de Conglomerados:
  - o Valor en Riesgo
    - Metodo histórico
    - Método paramétrico
    - Simulación de Montecarlo
  - o Análisis de Sensibilidad
  - o Análisis de correlación y covarianza
  - o Análisis de regresión
  - o Portafolios óptimos
- Aplicación a variables aleatorias del mercado colombiano y de algunas del mercado internacional.
- Ejercicios prácticos en Excel.

Sea esta una oportunidad para poner a su disposición toda la información relativa a los programas que a la fecha tenemos y que los pueden consultar en nuestra página web [www.asobursatil.org](http://www.asobursatil.org).

