

Metodología VaR

Madrid
Marzo 2018

Formación

Fecha | 26 de marzo de 2018

Horario | De 09:00 a 15:00 h.

Duración | 6 horas

Modalidad | Presencial

Objetivo

- Conocer la metodología VaR, abordando fundamentalmente su variante práctica, como herramienta de las entidades aseguradoras para la medición del riesgo de mercado en el contexto de Solvencia II. Este curso pretende abordar de una forma práctica, su utilización por parte de las compañías aseguradoras.

Programa y Contenidos

- El riesgo de mercado.
- Herramientas para la medición del riesgo de mercado: Diferencia entre medidas matemáticas y probabilísticas.
- El VaR
- La volatilidad en el cálculo del VaR.
- Conceptos asociados: TailVaR, incremental VaR.
- Pruebas de back-testing/sanity check.
- Utilización de escenarios de estrés (stress-testing).

Ponente

Jonathan Sánchez Porta

Colaborador asociado AREA XXI

Diplomado en Estadística. Universidad Complutense de Madrid.
2 años como Responsable de las Funciones de Riesgos y Cumplimiento Normativo en A.M.A.
13 años de Actuario de No Vida en las aseguradoras Direct Seguros, AXA y A.M.A.
Colaborador habitual de ICEA

Precio

Entidades Adheridas: 220 euros + 21% IVA
Entidades No Adheridas: 330 euros + 21% IVA

Datos bancarios: La cuota de inscripción puede hacerse efectiva en las oficinas de ICEA, o bien mediante transferencia bancaria a nuestra c/c nº: IBAN ES49 0081-7118-57-0001087611 del Banco Sabadell Atlántico de la calle Juan Bravo, 51 (28006 Madrid).

Acción formativa bonificarle a través de FUNDAE (Fundación Estatal para la Formación en el Empleo).
Para más información contacte con marta.collada@icea.es

Lugar de impartición



Aulas de ICEA
López de hoyos, 35
28002 Madrid



La celebración del curso está condicionada a la inscripción de un número mínimo de asistentes. Programa, fechas de realización y ponentes pueden ser modificados por necesidades organizativas.

Si desea más información, contacte con nosotros: formacion@icea.es



el valor del conocimiento