



Descriptivo

# Taller didáctico vía web - Gestión de Riesgo en las Organizaciones: Conceptualización y uso de herramientas informáticas.

## Descripción:

La conferencia abordará desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de Riesgo dando al asistente las herramientas claves 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 ejemplo práctico 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:

La conferencia vía Internet está dirigida a personas interesadas en la Gestión, Control y Modelación de Riesgo que deseen cubrir el marco teórico del área sin exponerse de una manera extensa a los detalles de complicados modelos matemáticos, pero si en obtener los mejores resultados para tomar decisiones sobre sus proyectos en momentos de incertidumbre. Los asistentes podrán actualizarse y debatir temas correspondientes a Riesgo y en el uso de herramientas informáticas.



## Objetivo:

El objetivo primordial es 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. Se hará una demostración para reflejar la importancia del uso de la Simulación de Monte Carlo.



## Temario:

Crisis financiera y económica  
¿Qué es riesgo?  
Tipos de riesgo

Normatividad

¿Cómo hacer una buena gestión del riesgo?

Risk Simulator como herramienta en la gestión del riesgo

Introducción al Método de Montecarlo

Determinación de variables supuestos

Determinación de variables pronóstico

Estructuración de un experimento

Ejemplo de simulación Montecarlo con Risk Simulator

Riesgo de Mercado

Riesgo de Crédito

Riesgo Operacional

Sesión de preguntas



Instructores:

### **Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.**

Economista, especialista en gestión de riesgos financieros y magister en finanzas, cuenta con la certificación CQRM y la certificación Financial Risk Management (FRM). Actualmente es el líder del área de consultoría y auditoría de gestión de riesgos financieros de KPMG Colombia desempeñándose como Gerente Senior, ha sido gerente de consultoría en KPMG Panamá. Se desempeñó como jefe de riesgo de mercado y liquidez en el Banco Mundo Mujer y en áreas de riesgo y tecnología en Banco de Bogotá, Banco Davivienda y Software Shop. Cuenta con amplia experiencia en construcción, modelación, revisión, auditoría y asesoría de modelos de gestión de riesgo de mercado, crédito, operacional y liquidez en entidades financieras y no financieras con el uso de herramientas cuantitativas y cualitativas.