



Descriptivo

# Conferencia: Herramientas Informáticas para la Medición de Riesgos.

## Descripción:

Aplicación de temas financieros y económicos con un software de simulación, lo que le permitirá al asistente mejorar su efectividad en la toma de decisiones.



### Dirigido a:

Personas que manejan información financiera y económica, y que desean utilizar técnicas que le permitan evaluar miles de escenarios por medio de la simulación de Monte Carlo, de igual forma que desean utilizar técnicas robustas técnicamente pero que sean de fácil manejo para realizar pronósticos de variables financieras, económicas, de producción, ventas, entre otras aplicadas a la medición del riesgo financiero.



### Objetivo:

- Objetivo primordial es llevar al asistente por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico, para que pueda tener una contextualización en el manejo, simulación, pronóstico y optimización. - Analizar e interpretar resultados estadísticos, de manera gráfica y numérica. - Aplicación de temas financieros y económicos con un software de simulación, lo que le permitirá al asistente mejorar en la toma de decisiones.



### Temario:

#### 1. Riesgo de Crédito con Stata

- a. Análisis de modelos LOGIT
- b. Cálculo de probabilidades de default
- c. Pérdidas Esperadas

#### 2. Riesgo de Mercado y Riesgo Operacional con Risk Simulator

- a. Qué es el Value at Risk (VaR)?
- b. Metodologías de medición del VaR.
- c. Utilización de la simulación de Monte Carlo en el cálculo del VaR
- d. Modelación de Riesgo Operacional con Monte Carlo

#### Medición de Volatilidad con EViews.

- a. EWMA
- b. Modelos ARCH - GARCH



### Instructores: