Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Especializado vía web: Análisis Cuantitativo de Riesgo con apoyo de Risk Simulator y ModelRisk

Descripción

El Entrenamiento aborda desde un enfoque sencillo y práctico algunos modelos de medición de riesgo cuantitativo, dando al estudiante herramientas básicas que le permitirán desempeñarse eficientemente en el manejo del riesgo. Al completar este curso, los participantes habrán sido expuestos a los conceptos y las técnicas que son prerrequisitos necesarios para llevar a cabo un análisis de riesgo y para tomar una decisión defendible; se utilizarán como herramientas de apoyo los software Risk Simulator y ModelRisk.

Dirigido a

Este curso está dirigido a personas interesadas en temas de manejo, modelación y medición de riesgo, que deseen cubrir el marco teórico del área sin exponerse de una manera extensa a los detalles de complicados modelos matemáticos. El nivel de dificultad del curso será básico e intermedio.

Objetivo

Llevar al asistente por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico, para que pueda tener una contextualización en el manejo, modelación y medición del riesgo.

Temario

Introducción al Análisis de Riesgo
Qué es el riesgo y los tipos de riesgo

Fundamentación Estadística
Estadística descriptiva
Probabilidad y variables aleatorias

Introducción a la modelación del Riesgo
¿Qué es un modelo?
Pasos en el desarrollo de un modelo
Seleccionando una distribución

Simulación como herramienta de análisis
Qué es una simulación?
Simulación de Montecarlo
Hipercubo Latino
Otros tipos de simulaciones
Ventajas de las simulaciones
Correlaciones y cópulas

Pronóstico, capacidad de conocer el futuro
Corte transversal, series de tiempo y Datos panel
Trend, volatility, seasonality, autocorrelaton, cyclicity, mean reversion, jump diffusion
Pronósticos de series de tiempo
Modelos ARIMA

Modelos de volatilidad
Promedios móviles
EWMA
La familia GARCH

Instructores

Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.
Economista, con especialización en gestión de riesgos financieros y maestría en finanzas. Cuenta con más de 10 años de experiencia en la industria bancaria, financiera y de consultoría. Actualmente, es el Director de Riesgos Financieros en KPMG Colombia, en donde lidera procesos de implementación de gestión de riesgos, analítica de datos y machine learning en diferentes sectores e industrias para entidades públicas y privadas. Es profesor de cursos de posgrado en diferentes instituciones como la Universidad del Rosario, EAFIT y el Politécnico Grancolombiano. Además, hace parte del equipo de instructores del área cuantitativa de Software Shop, en donde trabaja con diferentes herramientas para el análisis estadístico y econométrico.

Información General

Duración
15 horas

Fecha de Inicio
Sáb. 04 de Dic de 2010

Horarios
Fechas y horarios:

Diciembre 4 de 2010: sábado (Sesión de tres horas)

San José de Costa Rica 8:00 a.m
México D.F. 8:00 a.m
Bogotá 9:00 a.m.
Lima 9:00 a.m.
Caracas 9:30 a.m
Santiago 11:00 a.m
Buenos Aires 11:00 a.m

Diciembre 6, 7, 9 y 10 de 2010: Lunes, martes, jueves y viernes

(Sesiones de tres horas cada una)

San José de Costa Rica 3:00 p.m.
México D.F. 3:00 p.m.
Bogotá 4:00 p.m.
Lima 4:00 p.m.
Caracas 4:30 p.m.
Santiago 6:00 p.m.
Buenos Aires 6:00 p.m.

Sesiones de Tutoría durante la semana de la capacitación

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link https://www.software-shop.com/formacion/politicas

Inscríbete ahora