

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 prerequisites 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, especialista en gestión de riesgos financieros y magíster 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 Director, ha sido gerente de consultoría en KPMG Panamá y líder del área cuantitativa en 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.

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



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