

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Especializado Fundamentación en Administración de Riesgo con apoyo de Risk Simulator Vía Web

Descripción

El Entrenamiento aborda desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo dando al estudiante herramientas básicas que le permitirán iniciar el mundo del manejo del riesgo. Los asistentes podrán interactuar con el software Risk Simulator que les permitirá cuantificar el riesgo y servir de herramienta en la toma de decisiones. 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 utilizando el software de Risk Simulator.

Dirigido a

Este módulo está dirigido a personas interesadas en temas de control de riesgo y modelación 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.

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, modelación, medición y administración del riesgo.

Temario

1. Introducción a la Teoría del Riesgo

Qué es el riesgo y los tipos de riesgo

Riesgo de crédito

Riesgo de Mercado

Riesgo Operacional

Gestión del Riesgo

2. Fundamentación Estadística para el Manejo de Modelos de Riesgo

Estadística descriptiva

Probabilidad y variables aleatorias

Teorema central del límite (Conceptos básicos)

¿Qué es la Simulación Montecarlo? (Ej. VPN en MS Excel)

3. Introducción al Software de Risk Simulator como herramienta de apoyo en la gestión del riesgo

MS Excel y Risk Simulator

Risk Simulator como complemento

Versiones del software

Ventajas respecto a otros simuladores

Requerimientos de Hardware y Software

Manejo de la barra de herramientas Risk Simulator

4. Introducción a la modelación con Risk Simulator

¿Qué es un modelo?

¿Qué es una simulación?

Pasos en el desarrollo de un modelo

Seleccionando una distribución

Introducción al BestFit

Ejercicio práctico:

Preparando un modelo de simulación

Definición de supuestos

Correlación de supuestos

Definición de pronósticos

Editando los datos de Risk Simulator

5. Toma de decisiones con Risk Simulator

Introducción a la optimización bajo incertidumbre

Tomando buenas decisiones bajo incertidumbre: Análisis de sensibilidad y tornado

Construyendo modelos

Ejercicios

6. Modelación de Riesgo con Risk Simulator, ejercicios prácticos:

Riesgo de Mercado y VaR Riesgo de Crédito, matrices de transición y cálculo de probabilidades de incumplimiento

Riesgo Operacional, Operational VaR

7. Pronósticos con Risk Simulator

7.1 Introducción a la Econometría

¿Qué es Regresión?

¿Qué son los Modelos de Series de Tiempo?

Modelos Básicos de Pronóstico (Promedio Móvil Simple, Doble, Suavizamiento Exponencial, Holt Winters Estacionales)

Modelos ARIMA

7.2. Ejercicios de Pronósticos

Pronóstico de Ventas

Pronósticos de Variables Macroeconómicas

Pronósticos de Estados Financieros

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

16 horas

Fecha de Inicio

Sáb. 16 de Abr de 2011

Horarios

Fechas y Horarios

Sábados

Abril 16, 30, Mayo 7 y 14 de 2011

Sesiones de cuatro horas

San José de Costa Rica 8:00 a.m

México D.F. 9:00 a.m

Bogotá 9:00 a.m

Quito 9:00 a.m

Lima 9:00 a.m.

Caracas 9:30 a.m

Bolivia 10:00 a.m.

Santiago 11:00 a.m

Buenos Aires 11:00 a.m

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