

Webcast

Taller didáctico via web Riesgo Operativo: Frecuencia y severidad - Cálculo del Operational VaR

Descripción

Se presentará la importancia de la medición del riesgo operativo y cómo por medio del software Risk Simulator se podrá calcular la distribución de frecuencia y de impacto para diferentes factores de riesgo internos y externos, así finalmente obtener la distribución de pérdidas por riesgo operativo para una institución financiera y su Operational VaR por medio de Simulaciones de Monte Carlo, permitiendo mejorar en la cuantificación del riesgo.

Dirigido a

Dirigido a profesionales y estudiantes que deseen utilizar las aplicaciones avanzadas que ofrece Risk Simulator para la gestión del riesgo de operativo.

Objetivo

Esta presentación expondrá de manera sencilla los temas teóricos y sin extenderse en los detalles de complicados modelos matemáticos.

Temario

1. Qué es Riesgo Operativo?
2. Importancia de la medición del Riesgo Operativo
3. Metodologías en la medición del Riesgo Operativo
4. Estimación de distribuciones de probabilidad de frecuencia e impacto
5. Cálculo de la distribución de pérdidas y el Opt. VaR
6. Conclusiones
7. 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.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Vie. 22 de Jun de 2012

Horarios

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 10:00 a.m.
Buenos Aires 11:00 a.m



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