

### Descripción

Dada la importancia que ha tomado la medición y cálculo del riesgo a partir de las crisis presentadas a nivel mundial principalmente, como la del 98, 2008 y 2010, se ha evidenciado algunos avances a nivel teórico para la medición del riesgo pero no son suficientes para lograr establecer el riesgo de una quiebra; los parámetros establecidos por Basilea I y Basilea II no han sido suficientes para una correcta gestión del riesgo de acuerdo a los efectos de la última crisis financiera. Por tal razón, es necesario que se implementen en las unidades de riesgo modelos mucho más robustos que permitan captar los diferentes comportamientos de las variables del mercado, las series económicas y financieras suelen presentar conglomerados de volatilidad, lo que genera que el supuesto de normalidad de la rentabilidad de un activo no se cumpla, una forma de modelar éste tipo de variables es por medio de modelos ARCH y GARCH.

### Dirigido a

Directores, analistas de riesgos, analistas de estudios económicos, áreas de planeación de las diferentes entidades del sector financiero.

### Objetivo

Con una presentación teórico práctica se analizarán variables financieras del mercado de valores, modelando la volatilidad por diversas metodologías GARCH y usando la volatilidad para estimar el Valor en Riesgo con el apoyo del software econométrico Stata y el software de simulación Risk Simulator.

### Temario

#### Parte I

1. Metodologías de medición del VaR
2. Modelos de Volatilidad
3. Tipos de modelos GARCH
4. Análisis de variable financiera
5. Estimación de modelo VaR GARCH y Monte Carlo
6. Conclusiones

#### Parte II

1. Introducción a las Opciones Financieras.
2. Utilización simulación de Montecarlo en la Valoración de Opciones.
3. Ejemplos práctico con Opciones Barrera.

### 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. 08 de Jun de 2012

### Horarios

7:00 p.m.

Universidad San Martín de Porres

### Ciudad

Lima (Lima, Perú)

### Lugar:

SOFTWARE shop - Lima

Herramientas de apoyo



**STATA**<sup>®</sup>

Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

### 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