

# Entrenamiento Especializado

Entrenamiento especializado vía web: Fundamentación Integral en Gestión de Riesgos con Risk Simulator

## Descripción

El Entrenamiento aborda desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo ofreciendo al participante herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la administración y gestión 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 entrenamiento los participantes manejarán los conceptos y técnicas necesarios para llevar a cabo un análisis de riesgo para la posterior toma de decisiones.

## Dirigido a

Directores, Gerentes, Subgerentes, Jefes y Analistas en Áreas de Riesgos, Finanzas, Administración, Inversiones, Auditoría provenientes de Entidades del Sector Gobierno, Entidades Financieras entre otras, interesados en ampliar sus conocimientos en la gestión de riesgos.

## Objetivo

El objetivo primordial es llevar al asistente por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico para lograr una mayor contextualización, manejo, modelación, medición y administración del riesgo. Analizar e interpretar resultados estadísticos de manera gráfica y numérica. Aplicación de temas financieros y económicos con RISK SIMULATOR, como herramienta de apoyo para la toma de decisiones.

## Temario

### 1. Fundamentación

- a. Estadística Descriptiva
- b. Probabilidad y Variables Aleatorias
- c. Teorema Central del Límite (Conceptos Básicos)
- d. ¿Qué es la Simulación de Montecarlo? (Ej VPN en MS Excel)

### 2. Introducción al Software

- a. Aplicaciones Generales
- b. Manejo de los menús

### 3. Simulación de Monte Carlo

- a. Simulación de Monte Carlo e Hipercubo Latino
  - b. Variables de entrada y pronóstico
  - c. Edición de variables
  - d. Ajuste de Distribución Automático y pruebas de bondad de ajuste
    - i. Variables continuas
    - ii. Variables discretas
  - e. Preferencias de la simulación y nivel de precisión
  - f. Ejecución del modelo
  - g. Análisis de las estadísticas de simulación
  - h. Análisis Tornado, Araña y de Sensibilidad
  - i. Sobreposición de variables
  - j. Correlación de supuestos
- Ejemplo de Simulación de Ventas, Ajuste de Distribución de Producción, Ingresos, Compras, Precios, Commodities.

### 4. Introducción al Riesgo

- a. Tipos de Riesgo
- b. Importancia del análisis de variables
- c. Gestión del Riesgo

### 5. Riesgo de Crédito con Risk Simulator

- a. Análisis de modelos LOGIT
- b. Cálculo de probabilidades de default
- c. Pérdidas Esperadas

#### 6. Riesgo de Mercado con Risk Simulator

- a. Value at Risk (VaR)
- b. Metodologías de medición del VaR.
- c. Utilización de la simulación de Montecarlo en el cálculo del VaR

#### 7. Optimización

- a. Optimización de Portafolios usando Risk Simulator
- b. Optimización estática, dinámica y estocástica
- c. Ejercicios de optimización

#### 8. Pronóstico

- a. Introducción a la Econometría
- b. Qué es Regresión?
- c. Qué son los Modelos de Series de Tiempo?
- d. Modelos Básicos de Pronóstico (Promedio Móvil Simple, Doble, Suavizamiento Exponencial, Holt Winters Estacionales)
- e. Ejercicios de Pronósticos

### 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.

Miller Franco Lemus

Contador Público, Especialista en Ingeniería Financiera con énfasis en valoración de instrumentos financieros derivados de la Universidad Nacional de Colombia y Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CRM, impartido por el Dr. Johnathan Mun y otorgado por el Instituto IIPER. Gran experiencia en el análisis económico y financiero en los modelos de expansión, desempeñándose como Coordinador financiero del Grupo Expansión de Negocios. Amplio conocimiento y experiencia en la implementación de productos financieros derivados y de renta fija en el sector financiero colombiano. Se ha desempeñado como docente en las áreas de gestión de riesgos y derivados financieros en la Universidad Piloto de Colombia, docente de cursos de Excel avanzado y macros en la Universidad Nacional de Colombia y San Martín, además de participar como conferencista invitado en otras Universidades del país en temas relacionados con la gestión del riesgo y valoración de instrumentos financieros derivados. Actualmente se desempeña como Analista Sénior para la implementación de productos financieros derivados y de renta fija en el sector Financiero Colombiano.

## Información General

### Duración

16 horas

### Fecha de Inicio

Mar. 02 de Abr de 2013

### Horarios

Fechas: Abril 2, 4, 6, 9 y 11 de 2013

Sesiones entre semana:

**Martes, Jueves (3 horas por sesión)**

San José de Costa Rica 3:00 p.m.

México D.F. 3:00 p.m.

Bogotá 4:00 p.m.

Quito 4:00 p.m.

Lima 4:00 p.m.

Caracas 4:30 p.m.

Bolivia 5:00 p.m.

Santiago 6:00 p.m.

Buenos Aires 6:00 p.m.

**Sesión Sábado (4 horas)**

San José de Costa Rica 8:00 a.m.

México D.F. 8:00 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.



**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