

# 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, 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.

#### **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