

Entrenamiento Especializado

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 Gran Colombiano. 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

Mar. 05 de Mar de 2013

Horarios

2:00 p.m. a 6:00 p.m.

Ciudad

Caracas (Distrito Capital, Venezuela)

Lugar:

SOFTWARE shop

Herramientas de apoyo



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