

Entrenamiento Especializado

Fundamentación Integral en Gestión de Riesgos con Risk Simulator
v2013

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.

Información General

Duración

16 horas

Fecha de Inicio

Lun. 18 de Mar de 2013

Horarios

3:00 p.m. a 6:30 p.m.

Ciudad

Lima (Lima, Perú)

Lugar:

Universidad del Pacífico



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