

Entrenamiento Especializado

Gestión de Riesgos Financieros con el apoyo de Risk Simulator.

Descripción

Los asistentes podrán interactuar con el software como herramienta que les permitirá cuantificar el riesgo. Al completar este curso, los participantes manejarán los conceptos y las técnicas que son prerrequisitos necesarios para llevar a cabo un análisis de riesgo y para tomar decisiones fundamentadas, utilizando Risk Simulator.

Dirigido a

Este entrenamiento está dirigido a personas interesadas en control de riesgo y modelación que deseen cubrir el marco teórico del área sin exponerse de una manera extensa a los detalles de complicados modelos matemáticos pero obteniendo avanzados resultados en términos estadísticos y financieros. Profesionales con conocimientos básicos en Riesgo y/o que quieran desempeñarse como analistas, modeladores, estudiantes, docentes y/o profesionales en áreas de estadística, economía, contaduría, riesgo, finanzas y demás relacionados con el tema.

Objetivo

Brindar a los participantes herramientas y metodologías prácticas para mitigar las incertidumbres y el riesgo, introduciéndolos en los conocimientos teóricos y metodologías de valoración de riesgos financieros (Mercado, Crédito y Operacional) y desarrollar habilidades en el manejo de Risk Simulator como herramienta para la toma de decisiones.

Temario

1. Simulación de Montecarlo con Risk Simulator:

- Análisis de Simulación de Montecarlo
- Correlacionar y Truncar Distribuciones
- Alternar Parámetros y Simulaciones Multidimensionales
- Ajuste de Distribuciones

2. Optimización con Risk Simulator:

- Optimización Continua
- Optimización Discreta
- Optimización Estocástica

3. Pronósticos con Risk Simulator:

- Pronósticos de Series de Tiempo
- Análisis de Regresión Multivariado
- Box Jenkins ARIMA
- Procesos Estocásticos

4. Árboles de Decisión con Risk Simulator:

- ¿Cómo construir un Árbol de Decisión?
- Diseño del Árbol de Decisión
- Introduciendo Incertidumbre a un Árbol de Decisión
- Tomando Decisiones usando Árboles de Decisión

5. Gestión de Riesgo de Mercado:

- Metodología de Duración, Duración Modificada y Sensibilidad
- Riesgo de Convexidad
- Cálculo del VaR
- Metodologías para la Medición del VaR: Delta Normal, Simulación Histórica, Montecarlo
- Modelo de Optimización de Portafolio de Acciones

6. Gestión de Riesgo de Crédito:

- Modelo de Scoring
- Modelo Logit
- Cálculo de Probabilidades de Default
- Pérdidas Esperadas, Pérdidas Inesperadas
- Cálculo del Credit VaR

7. Gestión del Riesgo Operacional:

- Modelo de Severidad de Pérdidas
- Modelo de Frecuencia de Pérdidas
- Cálculo del Operational VaR

8. Cobertura con Futuros y Forwards:

- Introducción a los mercados a Forward y Futuros.
- Variación de Futuros y Forward.
- Cobertura con Futuros sobre Índices.

Instructores

Fernando Jáuregui Puertas

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos CRM, impartida con el Dr. Jonathan Mun. Profesional en Ciencias Económicas de la Universidad Nacional de Ingeniería del Perú. Executive Master in Financial Analysis en la Universidad Carlos III de Madrid (España). Adicionalmente, cuenta con especialización en Gestión de Riesgos Financieros en BURSEN (Centro de Estudios Bursátiles de la Bolsa de Valores de Lima) y en Formulación y Evaluación de Proyectos de Inversión Pública en la Universidad ESAN. Actualmente es docente de la Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico (Perú) e instructor de SOFTWARE shop para LATAM. Tiene experiencia en el sector público como Analista de Proyectos de Inversión y en el Sector Bancario como Analista de Estudios Económicos. Anteriormente se desempeñó como docente de la Facultad de Ingeniería Económica de la Universidad Nacional de Ingeniería (Perú), en las asignaturas de Econometría II y Análisis de Series Temporales.

Información General

Duración

20 horas

Fecha de Inicio

Lun. 18 de Nov de 2013

Horarios

De: 14:00 a 18:00

Ciudad

Caracas (Distrito Capital, Venezuela)

Lugar:

SOFTWARE shop



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