Entrenamiento Especializado

Gestión de Riesgos Financieros con el apoyo de Risk Simulator

Descripción

Al finalizar el entrenamiento, los participantes estarán en capacidad de manejar los conceptos y las técnicas que son pre-requisitos necesarios realizar análisis de riesgo y tomar decisiones fundamentadas. Los asistentes podrán interactuar con el software Risk Simulator como herramienta herramienta tecnológica.

Dirigido a

Entrenamiento 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 y 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 la incertidumbre 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 tecnológica de apoyo para el procesamiento de datos, análisis y toma de decisiones.

Temario

Simulación de Montecarlo con Risk Simulator:

1.Análisis de Simulación de Montecarlo
2.Correlacionar y Truncar Distribuciones
3.Alternar Parámetros y Simulaciones Multidimensionales
4.Ajuste de Distribuciones

Optimización con Risk Simulator:

1.Optimización Continua
2.Optimización Discreta
3.Optimización Estocástica

Pronósticos con Risk Simulator:

1.Pronósticos de Series de Tiempo
2.Análisis de Regresión Multivariado
3.Box Jenkins ARIMA
4.Procesos Estocásticos

Árboles de Decisión con Risk Simulator:

1.¿Cómo construir un Árbol de Decisión?

2.Diseño del Árbol de Decisión
3.Introduciendo Incertidumbre a un Árbol de Decisión
4.Tomando Decisiones usando Árboles de Decisión

Gestión de Riesgo de Mercado:
1. Metodología de Duración, Duración modificada y Sensibilidad
2. Riesgo de Convexidad
3. Cálculo del VaR.
4. Metodologías para la Medición del VaR: Delta Normal, Simulación Histórica, Montecarlo
5. Modelo de Optimización de Portafolio de Acciones.
6. Simulación de Brechas de Liquidez, Tasa de Interés.

Gestión de Riesgo de Crédito:
1. Modelo de Scoring a. Modelo Logit
2. Cálculo de Probabilidades de Default
3. Pérdidas Esperadas, Pérdidas Inesperadas
4. Cálculo del Credit-VaR
5. Matrices de Transición

Gestión de Riesgo Operacional:
1. Modelo de Severidad de Pérdidas
2. Modelo de Frecuencia de Pérdidas
3. Evaluación de Controles
4. Modelación de la BD de Pérdidas
5. Cálculo del Operational VaR

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

24 horas

Fecha de Inicio
Sáb. 02 de Nov de 2013

Horarios
9:00 a 18:00

Fechas:
Noviembre 2, 9 y 16 de 2013

Lugar:
UNIVERSIDAD PERUANA DE CIENCIAS APLICADAS.
Av. Salaverry 2255 Campus San Isidro.
Laboratorio A-701.
Lima Perú.

Ciudad
Lima (Lima, Perú)

Lugar:
Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas Sede Isidro

Herramientas de apoyo
Risk Simulator

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