

Taller

Taller: Modelos de Probabilidad para la Estimación y Medición de Riesgos Financieros Utilizando Software Especializado

Descripción

El taller se desarrollará con una metodología teórica, práctica e interactiva. El análisis grupal de casos prácticos permitirá desarrollar los conceptos y técnicas presentadas. Los participantes identificarán las oportunidades de mejora para aplicarlas en su organización. La participación y discusión de los casos y la evaluación de experiencias en diferentes áreas, ayudarán a reconocer la importancia de los procesos en las organizaciones. Así mismo, el taller está diseñado para repasar la parte conceptual y aplicativa de los modelos de probabilidad para la medición de riesgos financieros. La herramienta informática que utilizaremos será Stata, uno de los paquetes estadísticos más potentes, confiables y de fácil uso que existen en el mercado. A lo largo del taller, se hará un breve recorrido por la interfaz del programa (acercamiento), se realizarán ejemplos y ejercicios, y en todo momento habrá espacio para preguntas y participación activa.

Dirigido a

Este taller está dirigido a personas interesadas en temas de 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 y consultores preferiblemente 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

- Llevar al asistente por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico, para que pueda tener una contextualización en la administración de riesgos financieros, especialmente la de riesgos operativos.
- Comunicar los conceptos de riesgos financieros y la importancia de contar con una herramienta informática como elemento que permita optimizar las decisiones.
- Desarrollar habilidades en el manejo de Risk Simulator como herramienta en la administración y evaluación de riesgos financieros y la toma de decisiones.
- Repasar algunos conceptos básicos de la modelación econométrica para realizar estimaciones de probabilidad
- Explicar las rutinas de estimación y mostrar la interpretación de resultados obtenidos con el fin de tener insumos para la toma de decisiones.

Temario

Temario

Tema 01: Conceptos clave

Fundamentos estadísticos para el manejo de Modelos de riesgo

- Estadística descriptiva.
- Probabilidad y variables aleatorias.T
- Teorema central del límite (Conceptos básicos)
- ¿Qué es la Simulación Montecarlo? (Ej. VPN en MS Excel)
- Aproximaciones para manejar incertidumbre
- Estimación de punto único
- Análisis de escenarios
- Análisis de situaciones “Y si”
- Aproximación de simulación

Tema 02: Introducción a Risk Simulator

Simulación de Montecarlo

- Análisis de Simulación de Montecarlo
- Correlacionar y truncar la distribución
- Alternar Parámetros y simulaciones multidimensionales
- Ajuste de distribuciones

Tema 03: Gestión del Riesgo Operacional

Metodologías de Medición

- Método del Indicador Básico (BIA)
- Método Estándar (SA)
- Métodos de Medición Avanzada (AMA)
- Análisis de Montecarlo en los AMA
- Modelo de Severidad de Pérdidas
- Criterios de cuantificación de la severidad de Pérdidas
- Modelo de Frecuencia de Pérdidas
- Criterios de cuantificación de la frecuencia de Pérdidas
- Cálculo del Operational VaR

Instructores

William Zuluaga Muñoz

PhD en Derecho y Economía (C), Especialista en Gerencia de Proyectos certificado en Planeación Estratégica de la Universidad de Pittsburgh, Lean Six Sigma Green Belt. Más de 15 años de experiencia en la gestión financiera, compras y contratación de proyectos y en el primer proyecto de certificación de Sello Ambiental Colombiano para productos eléctricos para la empresa líder mundial en sostenibilidad. Además, es ángel inversionista de varias redes y asesor de junta directiva en empresas startups.

Información General

Duración

5 Horas

Fecha de Inicio

Sáb. 23 de Ago de 2014

Horarios

Sábado 23 de Agosto de 2014.

Hora: 8:00 am a 1:00 pm

Claudia Sánchez convocó a este grupo de la Universidad Valle de Guatemala aprovechando su visita a Bogotá para ofrecerles este taller de inducción apoyado con RS para futuras negociaciones de licenciamiento y CRM para el 2015. Este evento se ofreció gratuito a los participantes.

Ciudad

Bogotá (Bogotá, Colombia)

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