

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Online: Métodos y Herramientas para la Medición de Riesgo de Mercado y Liquidez con el apoyo de Risk Simulator.

Descripción

El curso aborda los temas más importantes para la medición de riesgos financieros con casos aplicados, haciendo énfasis en el de mercado y liquidez. Tendrá una duración de 26 horas incluyendo una parte introductoria al software para aquellas personas que no lo conocen y para que otras fortalezcan las habilidades en el manejo de Risk Simulator.

Dirigido a

Profesionales, docentes, estudiantes y en general a todas las personas que trabajen o estén interesadas en aprender las principales metodologías para la medición de riesgo de mercado y liquidez apoyado en la simulación de Monte Carlo.

Objetivo

Ofrecer al participante los conceptos y herramientas necesarias para llevar a cabo una gestión de riesgos eficiente con el apoyo de herramientas especializadas.

Presentar los modelos de medición de riesgo de mercado y liquidez recomendados a nivel internacional.

Temario

1. Introducción al Software Modelos estáticos y dinámicos

Ajuste de Distribución para variable aleatoria discreta y continua
Truncamiento de Distribuciones de Probabilidad
Correlación entre supuestos de Entrada
Exportación e importación de resultados simulados
Interpretación de resultados (Histogramas y momentos de una distribución)

2. Riesgo de Mercado

Optimización de portafolios de inversión: renta variable y renta fija
Riesgo Delta (Tasa de Interés, tasa de cambio y acciones)
Metodologías para calcular el Valor en Riesgo para activos renta variable
Simulación Histórica
Simulación de Monte Carlo
Modelos Paramétricos
Volatilidad Histórica
Volatilidad Dinámica
Volatilidad Condicional
Metodologías para calcular el Valor en Riesgo para activos renta fija
Riesgo de Pendiente: Duración Modificada y Convexidad VaR para renta Fija

Pruebas de Tensi3 Back Testing del VaR
Pruebas de Rachas de Kupiec VaR vs CVaR
C3culo de reserva bajo Niif 9

3. Riesgo de Liquidez

Brechas de los Flujos de Efectivo
An3lisis de Brechas y C3culo del Indicador de Riesgo de Liquidez Gap:
Liquidez, Madurez y Duraci3n Administraci3n de Activos y Pasivos
ALM VaR de Riesgo de Liquidez
C3culo del riesgo de liquidez de mercado
Generaci3n de indicadores de liquidez de t3tulos

Instructores

Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.

Economista, con especializaci3n en gesti3n de riesgos financieros y maestr3a en finanzas. Cuenta con m3s de 10 a3os de experiencia en la industria bancaria, financiera y de consultor3a. Actualmente, es el Director de Riesgos Financieros en KPMG Colombia, en donde lidera procesos de implementaci3n de gesti3n de riesgos, an3lisis de datos y machine learning en diferentes sectores e industrias para entidades p3blicas y privadas. Es profesor de cursos de posgrado en diferentes instituciones como la Universidad del Rosario, EAFIT y el Polit3cnico Grancolombiano. Adem3s, hace parte del equipo de instructores del 3rea cuantitativa de Software Shop, en donde trabaja con diferentes herramientas para el an3lisis estad3stico y econom3trico.

Informaci3n General

Duraci3n

26 Horas

Fecha de Inicio

Lun. 28 de Nov de 2016

Horarios

Fechas:

Noviembre 28,29 y 30 de 2016

Diciembre 1, 2, 5, 6, 7, 9 y 12 de 2016

Duraci3n: 26 Horas

De lunes a viernes

Dos horas y 30 minutos por sesi3n

Hora de inicio por pa3s

17:00 San Jos3 de Costa Rica

17:00 M3xico D.F.

18:00 Bogot3

18:00 Lima
18:00 Quito
18:30 Caracas
19:00 La Paz
20:00 Santiago de Chile
20:00 Buenos Aires



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