

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 Tensió Back Testing del VaR
- Pruebas de Rachas de Kupiec VaR vs CVaR
- Cálculo de reserva bajo Niif 9

3. Riesgo de Liquidez

- Brechas de los Flujos de Efectivo
- Análisis de Brechas y Cálculo del Indicador de Riesgo de Liquidez Gap:
- Liquidez, Madurez y Duración Administración de Activos y Pasivos
- ALM VaR de Riesgo de Liquidez
- Cálculo del riesgo de liquidez de mercado
- Generación de indicadores de liquidez de ttulos

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

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

Duración: 26 Horas

De lunes a viernes

Dos horas y 30 minutos por sesión

Hora de inicio por país

17:00 San José de Costa Rica

17:00 México D.F.

18:00 Bogotá

18:00 Lima

18:00 Quito

18:30 Caracas

19:00 La Paz

20:00 Santiago de Chile

20:00 Buenos Aires

Herramientas de apoyo



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