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 títulos

Instructores

Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.
Economista, con especialización en gestión de riesgos financieros y maestría en finanzas. Cuenta con más de 10 años de experiencia en la industria bancaria, financiera y de consultoría. Actualmente, es el Director de Riesgos Financieros en KPMG Colombia, en donde lidera procesos de implementación de gestión de riesgos, analítica de datos y machine learning en diferentes sectores e industrias para entidades públicas y privadas. Es profesor de cursos de posgrado en diferentes instituciones como la Universidad del Rosario, EAFIT y el Politécnico Grancolombiano. Además, hace parte del equipo de instructores del área cuantitativa de Software Shop, en donde trabaja con diferentes herramientas para el análisis estadístico y econométrico.

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

Risk Simulator

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