

Taller

Conferencia: Medición de Riesgo en Finanzas e Inversiones.

Descripción

Esta conferencia abordará conceptos básicos sobre estadística, econometría y finanzas a partir de ejemplo prácticos sin dejar aún lado el componente teórico que subyace a los conocimientos sobre Pronóstico y Optimización de Carteras de Inversión. Tendrá como apoyo el uso de herramientas como Risk Simulator y OptiFolio para desarrollar rutinas de Simulación de Monte Carlo, Pronóstico de Series de Tiempo Univariadas y la Optimización de Carteras de Inversión.

Dirigido a

Profesionales, Docentes, Estudiantes y en general a todas las personas interesadas en profundizar en temas relacionados con los Métodos Cuantitativos aplicados a las Finanzas y al Mercado de Capitales.

Objetivo

1. Entender la utilidad que ofrece los Métodos Cuantitativos para la Medición de Riesgos Financieros.
2. Desarrollar destrezas y habilidades necesarias para el manejo idóneo de la Simulación de Monte Carlo como herramienta en la Toma de Decisiones.
3. Utilizar Herramientas Informáticas como Risk Simulator y OptiFolio para el mejoramiento de Estimaciones y la Eficiencia de los procesos que involucran cálculos matemáticos.

Temario

1. ¿Qué es el Riesgo Operativo?

- Tipos de Riesgo Operativo
- Revisión Práctica de los enfoques de indicador básico y estandarizado
- Ajuste de Distribución para variable aleatoria continua y discreta (Kolmogorov-Smirnov)
- Estimación del Valor en Riesgo y la Pérdida Esperada.

2. ¿Qué es el Riesgo de Crédito?

- Análisis del Modelo por Máxima Verosimilitud (LOGIT)
- Pronóstico de las Probabilidades de Incumplimiento
- Estimación de la Pérdida Esperada, No Esperada y Catastrófica

3. ¿Cómo asignar recursos de manera eficiente en un Portafolio de Inversión?

- Modelos de Carteras de Inversión (Markowitz, Betas, Sharpe, Black)
- Cálculo de Rentabilidad y Riesgo con Activos Primitivos y Activos Valorizados.
- Construcción de Modelos de Selección de Carteras (Markowitz)
- Como estimar sensibilidades vectoriales con respecto a factores de riesgo.
- Construcción de Modelos de Selección de Carteras Multidivisa.
- Construcción de Modelos de Selección de Carteras con el uso de Matrices de Factores de Riesgo (Renta Variable, Renta Fija, Divisas).
- Influencia de restricciones sobre la Frontera Eficiente.

- Uso de Carteras Benchmark: Restricciones Turn-Over
- Calculo de Valor en Riesgo (VaR) , CVaR y Contributonal VaR.
- Proyecciones del VaR con Análisis Monte Carlo
- Análisis de Desempeño mediante el Modelo de Brinson

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analítica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Roddy Rivas-Llosa

Licenciado en Economía y Magíster en Finanzas de la Universidad del Pacífico en Perú, con estudios de Especialización en Ingeniería Financiera en la Universidad de Harvard y la designación CFA Charterholder (USA). Se ha desempeñado como docente durante más de veinte años y ha sido autor de dos libros sobre Econometría y Finanzas. Actualmente es Director del Master in Management de la Pacífico Business School y representante de las Administradoras de Fondos de Pensiones del Perú ante la Superintendencia de Banca, Seguros y AFP. Adicionalmente, es socio de Innova Factoring, una empresa Fintech.

Información General

Duración

3 Horas

Fecha de Inicio

Vie. 23 de Jun de 2017

Horarios

De:

9:00 a.m a 12:00 m

Fecha:

Junio 23 de 2017

Lugar:

Instituto Politécnico Nacional - IPN

Escuela Superior de Economía

Edificio de Posgrados

Plan de Agua Prieta 66, Delegación Miguel Hidalgo,

Col. Plutarco Elías Calles, 11350
Ciudad de México, CDMX, México

Ciudad

Ciudad de México (Distrito Federal, México)

Lugar:

Instituto Politécnico Nacional - IPN



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