

# Taller

## Taller Práctico: Fundamentación en Métodos Cuantitativos y Gestión de Riesgos.

### Descripción

### Dirigido a

Este taller está dirigido a la Cajas Municipales de Ahorro y Credito del Perú adscritas a FPCMAC.

### Objetivo

### Temario

#### 1. Medición de Riesgo Operacional.

- a. Tipos de Riesgo Operativo
- b. Revisión Práctica de los enfoques de Indicador Básico y Estandarizado
- c. Ajuste de Distribución para variable Aleatoria Continua y Discreta (Kolmogorov-Smirnov)
- d. Estimación del Valor en Riesgo y la Pérdida Esperada.

#### 2. Medición de Riesgo de Mercado.

- a. Metodologías en la Medición de Riesgo de Mercado.
- b. Uso de la Simulación de Monte Carlo para la medición del VaR.
- c. Uso de la Metodología No Paramétrica para la medición del VaR
- d. Cociente de Fallas

#### 3. Medición de Riesgo de Crédito.

- a. Metodologías en la Medición de Riesgo de Crédito
- b. Cálculo de la Probabilidad de Incumplimiento: Matrices de Transición y Modelo Logit.
- c. Cálculo de la Pérdida Esperada y No Esperada a partir de Modelos Paramétricos y No Paramétricos

#### 4. Medición de Riesgo de Liquidez.

- a. Brechas de los Flujos de Efectivo.
- b. Análisis de Brechas y Cálculos del indicador de Riesgo de Liquidez.
- c. VaR de Riesgo de Liquidez.
- d. Generación de Indicadores de Liquidez para Títulos.

### Instructores

#### Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

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.

## Información General

### Duración

8 Horas

### Fecha de Inicio

Lun. 17 de Jul de 2017

### Horarios

Pendiente asistencia, José informa que el ingresa esta información

#### De:

9:00 am a 6:00 pm

#### Fecha:

Julio 17 de 2017

### Ciudad

Lima (Lima, Perú)

### Lugar:

SOFTWARE shop - Lima

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