

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Uso de la Simulación de Monte Carlo y el Pronóstico para la Medición de Riesgo de Mercado, Liquidez y Operacional

Descripción

En este entrenamiento se abordará desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo ofreciendo al participante herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la administración y la gestión del riesgo. Al finalizar el Entrenamiento los participantes manejarán conceptos y técnicas necesarias para llevar a cabo un análisis de riesgo para la posterior Toma de Decisiones apoyados en el uso de la herramienta Risk Simulator.

Dirigido a

Profesionales, Docentes, Estudiantes y en general a todas las personas que trabajen o estén interesadas en profundizar en las principales metodologías para la Medición de Riesgo de Mercado, Liquidez y Operacional haciendo uso de la Simulación de Monte Carlo.

Objetivo

- Entender la Simulación de Monte Carlo como Metodología para el modelado de la Incertidumbre en las Decisiones de Inversión.
- Ofrecer al participante 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, Liquidez y Operacional recomendados a Nivel Internacional.

Temario

Riesgo de Mercado

a. Metodologías en la Medición del Riesgo de Mercado.

Paramétrico

Simulación Histórica

Simulación de Monte Carlo

b. Cociente de Fallas

c. Proporción Log Probabilística

d. Elección de la Metodología para la Medición de Riesgo de Mercado. e. Técnicas para calcular Volatilidad

Histórica

Dinámica

Condicional

f. Calcular el Conditional VaR (CVaR) con las tres Metodologías.

g. Optimización de Portafolios de Inversión con el enfoque tradicional

h. Pruebas de Tensión

Riesgo de Liquidez

- a. Construcción de un Modelo de Brechas de los Flujos de Efectivo
- b. Identificación de Estacionalidad y Proyección de cuentas relevantes
- c. Análisis de Brechas y Cálculo del Indicador de Riesgo de Liquidez
- d. Identificación de variables a simular con el Análisis de Tornado y Araña e VaR de Riesgo de Liquidez

Riesgo Operacional

- a. ¿Qué es el Riesgo Operativo?
- b. Uso de las Distribuciones de Probabilidad
Distribución Personalizada
Asignación de Distribuciones Teóricas
Ajuste de Distribución Discreto para Calcular la Frecuencia de Eventos
Ajuste de Distribución Continuo para Calcular la Severidad de Eventos
- c. Cálculo de Pérdidas Esperadas y No Esperadas por MMA.
- d. Análisis de Regresión Múltiple.

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle, Magíster en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España y acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartida por el Dr. Johnathan Mun y otorgada por el Instituto IIPER. Actualmente, es consultor y docente en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) , además, se ha desempeñado como docente y director de tesis de maestría en diferentes universidades de la región así como expositor internacional e instructor especializado en temas de riesgo y finanzas como parte del equipo de instructores de Software Shop para Latinoamérica.

Información General

Duración

12 horas

Fecha de Inicio

Vie. 01 de Dic de 2017

Horarios

Fechas:

Diciembre 1 y 2 de 2017

Horarios:

Viernes 5:00 p.m. a 9:00 p.m.

Sábado 8:00 a.m. a 5:00 p.m.

Ciudad:

Quito, Ecuador

Ciudad

Quito (Pichincha, Ecuador)

Lugar:
SOFTWARE shop



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