

# 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. <div><br></div><div>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. </div>

### 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 Hora

### Fecha de Inicio

Mar. 23 de Ene de 2018

### Horarios

Fechas:

**Enero 23, 24, 25, 30 y 31 de 2018**

**Febrero 1, 6, 7, 8, 13 y 14 de 2018**

Duración: 26 Horas

De martes a jueves

Dos horas y 30 minutos por sesión

### Hora de inicio por país

17:00 San José de Costa Rica - CDMX

18:00 Bogotá - Lima - Quito

18:30 Caracas

19:00 La Paz

20:00 Santiago de Chile - Buenos Aires



### 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