

Entrenamiento Especializado

Medición de Riesgos en la Toma de Decisiones con el apoyo de Risk Simulator

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. Estas herramientas son: la simulación, la optimización y el pronóstico. Al finalizar este entrenamiento el participante manejará los conceptos y técnicas necesarias para llevar a cabo un análisis de riesgo para la posterior toma de decisiones en 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, liquidez, operacional y crédito haciendo uso de la Simulación de Monte Carlo.

Objetivo

1. Entender la simulación de Monte Carlo como metodología para el modelado de la incertidumbre en las decisiones de inversión.
2. Ofrecer al participante los conceptos y herramientas necesarias para llevar a cabo una gestión de riesgos eficiente con el apoyo de herramientas especializadas.
3. Presentar los modelos de medición de riesgo de mercado, liquidez, crédito y operacional que son recomendados a nivel internacional.

Temario

1. Introducción al Análisis Cuantitativo de Riesgos

- a. Marco conceptual de la Gestión Integral de Riesgos.
- b. Uso de la Generación de Números Aleatorios para el Análisis de Riesgos.
- c. Introducción al manejo de funciones de Ms Excel.
- d. Introducción al manejo de Risk Simulator:
 - Creación de Perfiles.
 - Generación de Números Aleatorios con Risk Simulator.
 - Ajustes de Distribución dada Información Histórica.
 - Pronóstico de Variables Relevantes.
 - Exportación de Resultados y Reportes Estadísticos.

2. 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.

3. 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

4. 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.

5. Riesgo de Crédito

- a. Construcción de matrices de transición.
- b. Análisis del Modelo por Máxima Verosimilitud, Logit y Probit.
- c. Pronóstico de las Probabilidades de Incumplimiento.
- d. Interpretación de Coeficientes.
- e. Estimación de la Pérdida Esperada, No Esperada y Catastrófica.

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

20 Horas

Fecha de Inicio

Lun. 12 de Mar de 2018

Horarios

Fechas:

Marzo 12 al 16 de 2018

Horario:

De 3:30 pm. a 7:30 p.m.

Lugar:

CIECAS

Dirección: Calle lauro Aguirre 120, esquina Sor Juana Inés de la Cruz, Col. Agricultura, Del. Miguel Hidalgo, C.P. 11360. CD México

Ciudad

Ciudad de México (Distrito Federal, México)

Lugar:

Centro de Investigaciones Económicas, Administrativas y Sociales. (CIECAS)



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