# **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.<div><br/>div><div><div>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. </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, 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 Liquide

#### 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 Porbit.
- c. Pronóstico de las Probabilidad de Incumplimiento.
- d. Interpretación de Coeficientes.
- e. Estimación de la Pérdida Esperada, No Esperada y Catastrófica.

#### **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 analitica 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**

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)

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