

Entrenamiento Especializado

Medición de Riesgos en la Toma de Decisiones con el apoyo de la Simulación de Monte Carlo

Descripción

En este entrenamiento se abordará el marco de la Gestión Cuantitativa de Riesgos sin exponerse de manera extensa a los detalles complicados de modelos matemáticos, logrando habilidades que permitan desempeñarse de forma más eficiente y eficaz en la formulación financiera y económica basada en riesgos. 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.

Dirigido a

El entrenamiento está dirigido a aquellas personas interesadas en conocer las herramientas analíticas para cuantificar el riesgo en la toma de decisiones usando Risk Simulator.

Objetivo

- Mostrar al participante la importancia de la Gestión Integral de Riesgos desde el enfoque cuantitativo.
- Introducir al participante en Técnicas de Simulación, Pronóstico y Optimización usando Risk Simulator.
- Analizar e interpretar resultados estadísticos de manera gráfica y numérica.
- Entender la Simulación de Monte Carlo como metodología para el modelado de incertidumbre en las decisiones de inversión.

Temario

Introducción al Análisis Cuantitativo de Riesgos

- Modelos Estáticos vs Modelos Estadísticos.
- Estadística Descriptiva e Inferencial en las decisiones.
- Asignación y Uso de las Distribuciones de Densidad de Probabilidad.
- Principales características y funciones de Risk Simulator.

Análisis de Riesgo en las Decisiones de Inversión

- Selección de la posible Distribución de Densidad de Probabilidad.
- Interpretación de Estadísticos Descriptivos.
- Identificación de variables relevantes en Proyectos de Inversión.
- Análisis de Escenarios y Búsqueda Objetivo.
- Optimización de Portafolios de Inversión y Frontera Eficiente.

Caso Aplicado en Seguros: Modelado de Frecuencia y Severidad.

Técnica de Pronóstico para el Análisis de Riesgo

- Regresión Lineal y Múltiple.
- Pronóstico de Series de Tiempo:

- Técnicas de Suavizamiento.
- Modelos ARMA y ARIMA.
 - Otras Técnicas de Pronóstico (Spline Cúbico).

Caso Aplicado en Riesgo de Crédito.

- Estimación, Validación e Interpretación de Coeficientes.
- Pronóstico de la Probabilidad de Incumplimiento.
- Cálculo de la Perdida Esperada e Inesperada en Carteras de Crédito.

Aplicaciones de la Simulación y Pronóstico en las Decisiones de Inversión.

- Métodos de Estimación de Volatilidad.
- Coeficiente de Variación.
- Flujo de Caja.
- Juicio de Expertos.

Caso Aplicado en Riesgo de Liquidez.

- Breve revisión a los Reportes en el Marco Normativo Boliviano.
- Cálculos de Volatilidad
- Volatilidad Simple (Desviación Estándar)
- Volatilidad Logarítmica
- Cálculo del Value at Risk de Liquidez
- Var Paramétrico
- Var por Simulación
- Modelo de Brechas de Liquidez
- Cálculo del Parámetro de Prepago de Cartera
- Cálculo del Parámetro de Default de Cartera
- Cálculo del Parámetro de Reinversión de Depósitos a Plazo.
- Medición del Riesgo de Concentración
- Riesgo de Liquidez Intradía
- Estabilidad de las Fuentes de Fondo.

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

16 horas

Fecha de Inicio

Mar. 17 de Jul de 2018

Horarios

De:

5:00 pm a 9:00 pm

Fecha:

Julio 17 al 20 de 2018

Lugar:

**EMI _ Escuela Militar de Ingeniería
Avenida Arce 2642 (Frente a Multicine)**

Ciudad

La Paz (La Paz, Bolivia)

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