

Certificación

CQRM - Certificación Internacional en Administración de Riesgo Cuantitativo COSTA RICA

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 Fondeo.

Instructores

Dr. Johnathan Mun - Ph.D., MS, MBA, BS, CRM, FRM, CFC, MIFC

Fundador y CEO de Real Options Valuation Inc, empresa global de consultoría, entrenamiento y desarrollo de software especializado en análisis avanzado de Gestión de Riesgo, Opciones Reales y Valoración Financiera, con presencia en más de 30 países. Como desarrollador del software, cuenta con más de 12 patentes, 10,000 páginas de material registrado y más de 20 libros escritos. Ha impartido seminarios a nivel mundial, es docente en el U.S. Naval Postgraduate School (Escuela de Postgrado Naval), en la Universidad de Ciencias Aplicadas en Zurich, Suiza, y ha colaborado en múltiples universidades entre ellas la Universidad Estatal de San Francisco y la Universidad de Santa Clara en California. Es consultor para empresas Fortune 500, entre ellas 3M, Airbus, Boeing, GE, Motorola, así como para el gobierno de los Estados Unidos, incluyendo el Departamento de Defensa y agencias federales.

Información General

Duración

24 horas

Fecha de Inicio

Lun. 29 de Oct de 2018

Horarios

Fechas:

Octubre 29, 30 y 31. Noviembre 1 y 2 de 2018

De 8:00 a.m. a 6:00 p.m.

Examen

Noviembre 1 de 2018

De 8:00 p.m. a 10:00 a.m.

Ciudad

San José de costa rica (San José, Costa Rica)

Lugar:

SOFTWARE shop - Lima

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