

Entrenamiento Especializado

Medición de Riesgos Financieros con el apoyo de la Simulación de Monte Carlo

Descripción

En este entrenamiento se abordarán, desde un enfoque sencillo y práctico, los diferentes tipos de riesgo ofreciendo al participante herramientas analíticas especializadas que le permitirán complementar el Análisis, Administración y Gestión de Riesgos Financieros. Al finalizar este entrenamiento el participante manejará los conceptos y técnicas necesarias para llevar a cabo un análisis de riesgo apoyado de la Simulación de Monte Carlo para la posterior Toma de Decisiones.

Dirigido a

Gerentes de Riesgos y Finanzas, Analistas Financieros, Consultores, Docentes, Investigadores, Estudiantes de disciplinas Financieras, Económicas e Ingenierías y en general todas aquellas personas interesadas en conocer los conceptos, aplicaciones y metodologías para la Cuantificación de Riesgos Financieros con el apoyo de la Simulación de Monte Carlo.

Objetivo

Ofrecer al participante los Conceptos y Herramientas necesarias para la Cuantificación de Riesgos Financieros.

Temario

Módulo I:

Introducción al Riesgo y Aplicación en Software

El concepto de Riesgo: ¿Qué es y por qué nos interesa conocerlo?

- Definición de Riesgo. El Riesgo y las Decisiones Estratégicas.
- Importancia de la Cuantificación de Riesgos.
- Clasificación de Riesgos.
- Metodología de Gestión Integral de Riesgos (GIR).

Conceptos de Estadística para la Cuantificación de Riesgos

- Medidas de Tendencia Central.
- Medidas de Dispersión o Variabilidad.
- Medidas de Distribución y Ubicación.
- Medidas de Asociación Lineal y No Lineal.
- Introducción a la Probabilidad.
- Distribución de Frecuencias y Probabilidad.
- Ley de los Grandes Números, Teorema del Límite Central.
- Intervalos de Confianza y Probabilidad.
- Pruebas de Hipótesis.

Modelado de situaciones para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa de Riesgos

- Análisis de Punto único.
- Análisis de Sensibilidad Estático: análisis tornado y gráfico araña.
- Análisis de Simulación de Monte Carlo.
- Análisis de Sensibilidad Dinámico.
- Análisis de Escenarios.

Módulo II:

Cuantificación de Riesgos Financieros

Estimación de Volatilidad en Proyectos de Inversión

- Coeficiente de Variación, VaR y Probabilidad.
- Aproximación del Logaritmo de los Flujos de Caja.
- Volatilidad de Precios: Desviación Estándar, EWMA y GARCH.
- Supuestos de Gestión y Método Delphi.

Cuantificación de Riesgo de Crédito

- Matrices de Transición para el Cálculo de la Probabilidad de Incumplimiento.
- Modelos de Regresión No Lineal: Logit y Probit.
- - Estimación de Coeficientes.
- - Interpretación de Coeficientes.
- - Validación del Modelo a partir de Tablas de Clasificación.
- - Pronóstico.
- Calculo de la Pérdida Esperada y No Esperada.

Cuantificación de Riesgo de Mercado

- Metodologías en la Medición del Riesgo de Mercado.
- - Paramétrico.
- - Simulación Histórica.
- - Simulación de Monte Carlo.
- Backtesting:
- - Cociente de Fallas.
- - Proporción Log-Probabilística y Test de Kupiec.
- - Verificación y Calibración.
- Técnicas para Calcular Volatilidad.
- - Histórica y Parcial.
- - Dinámica.
- - Condicional.
- Críticas al VaR y Metodología Alternativa, CVaR.
- Optimización de Portafolios de Inversión de manera Estocástica.
- Stress Testing.

Cuantificación de Riesgo de Liquidez

- Construcción del Modelo de Brechas de Flujos de Efectivo.

- Identificación de Estacionalidad y Proyección de Cuentas Relevantes.
- Análisis de Brechas y Cálculo del Indicador de Riesgo de Liquidez.
- Principales Indicadores de Concentración.
- VaR de Riesgo de Liquidez.

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

20 horas

Fecha de Inicio

Lun. 15 de Oct de 2018

Horarios

De:

14:00 a 18:00

Fecha:

Octubre 15 al 19 de 2018

Lugar:

Pacífico Business School

Ciudad

Lima (Lima, Perú)

Lugar:

Universidad del Pacífico

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