



Uso de la Simulación de Monte Carlo y el Pronóstico para la Medición de Riesgo de Mercado, Liquidez y Operacional.

DIRIGIDO A:

Profesionales, Docentes, Estudiantes y en general a todas las personas que trabajen o estén interesadas en profundizar en las principales metodologías para la Medición de Riesgo de Mercado, Liquidez y Operacional haciendo uso de la Simulación de Monte Carlo.

OBJETIVOS:

- Entender la Simulación de Monte Carlo como Metodología para el modelado de la Incertidumbre en las Decisiones de Inversión.
- Ofrecer al participante conceptos y herramientas necesarias para llevar a cabo una gestión de riesgos eficiente con el apoyo de herramientas especializadas.
- Presentar los Modelos de Medición de Riesgo de Mercado, Liquidez y Operacional recomendados a Nivel Internacional.

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.

Al finalizar el Entrenamiento los participantes manejarán conceptos y técnicas necesarias para llevar a cabo un análisis de riesgo para la posterior Toma de Decisiones apoyados en el uso de la herramienta Risk Simulator.



Diciembre

1 y 2

2017



Viernes 01 de Diciembre

De 4:00 Pm a 8:00 Pm

Sábado 02 de Diciembre

9:00 Am a 5:00 Pm.



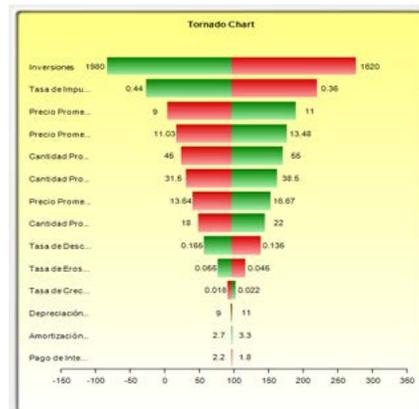
Quito, Ecuador



TEMARIO

Riesgo de Mercado

- Metodologías en la Medición del Riesgo de Mercado.
 - Paramétrico
 - Simulación Histórica
 - Simulación de Monte Carlo
- Cociente de Fallas
- Proporción Log-Probabilística
- Elección de la Metodología para la Medición de Riesgo de Mercado.
- Técnicas para calcular Volatilidad
 - Histórica
 - Dinámica
 - Condicional
- Calcular el Conditional VaR (CVaR) con las tres Metodologías.
- Optimización de Portafolios de Inversión con el enfoque tradicional
- Pruebas de Tensión



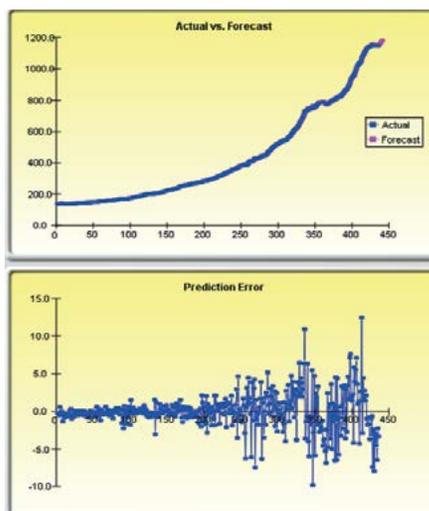
Riesgo de Liquidez

- Construcción de un Modelo de Brechas de los Flujos de Efectivo
- Identificación de Estacionalidad y Proyección de cuentas relevantes
- Análisis de Brechas y Cálculo del Indicador de Riesgo de Liquidez
- Identificación de variables a simular con el Análisis de Tornado y Araña
- VaR de Riesgo de Liquidez



Riesgo Operacional

- ¿Qué es el Riesgo Operativo?
- 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
- Cálculo de Pérdidas Esperadas y No Esperadas por MMA.
- Análisis de Regresión Múltiple.



DURACIÓN

12 Horas



Miguel Ángel Bello Bernal

Gerente del Portafolio de Riesgo de Software Shop para Latinoamérica. Se ha desempeñado como profesor de Estadística, Toma de Decisiones y Econometría Financiera en Especializaciones y Maestrías en diferentes universidades de Colombia.

Economista de la Universidad de la Salle, cuenta con Maestría en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España, acreditado con la Certificación en Gestión de Riesgos Cuantitativos (CQRM) otorgada por el Instituto IIPER (International Institute of Professional Education and Research)



Mayores informes:

José Luis Florián

✉ Joseluis@SOFTWARE-shop.com

📞 +57 (304) 545 - 2724

📄 [joseluis.florian](https://www.linkedin.com/in/joseluis.florian)