Entrenamiento Especializado

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

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.

Dirigido a

Profesionales, Docentes, Estudiantes y en general a todas las personas que trabajen o este?n interesadas en profundizar en las principales metodologi?as para la Medicio?n de Riesgo de Mercado, Liquidez y Operacional haciendo uso de la Simulacio?n de Monte Carlo.

Objetivo

- Entender la Simulacio?n de Monte Carlo como Metodologi?a para el modelado de la Incertidumbre en las Decisiones de Inversio?n.
- Ofrecer al participante conceptos y herramientas necesarias para llevar a cabo una gestio?n de riesgos eficiente con el apoyo de herramientas especializadas.
- Presentar los Modelos de Medicio?n de Riesgo de Mercado, Liquidez y Operacional recomendados a Nivel Internacional.

Temario

Riesgo de Mercado

a. Metodologi?as en la Medicio?n del Riesgo de Mercado.
Parame?trico
Simulacio?n Histo?rica
Simulacio?n de Monte Carlo

b. Cociente de Fallas

c. Proporcio?n Log Probabili?stica
d. Eleccio?n de la Metodologi?a para la Medicio?n de Riesgo de Mercado. e Te?cnicas para calcular Volatilidad
Histo?rica
Dina?mica
Condicional

f. Calcular el Conditional VaR (CVaR) con las tres Metodologi?as.
g. Optimizacio?n de Portafolios de Inversio?n con el enfoque tradicional
h. Pruebas de Tensio?n

Riesgo de Liquidez
a. Construccio?n de un Modelo de Brechas de los Flujos de Efectivo
b. Identificacio?n de Estacionalidad y Proyeccio?n de cuentas relevantes
c. Ana?lisis de Brechas y Ca?lculo del Indicador de Riesgo de Liquidez
d. Identificacio?n de variables a simular con el Ana?lisis de Tornado y Aran?a e VaR de Riesgo de Liquidez

Riesgo Operacional
a. ¿Que? es el Riesgo Operativo?
b. Uso de las Distribuciones de Probabilidad
Distribucio?n Personalizada
Asignacio?n de Distribuciones Teo?ricas
Ajuste de Distribucio?n Discreto para Calcular la Frecuencia de Eventos
Ajuste de Distribucio?n Continuo para Calcular la Severidad de Eventos

c. Ca?lculo de Pe?rdidas Esperadas y No Esperadas por MMA.
d. Ana?lisis de Regresio?n Mu?ltiple.

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 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

12 horas

Fecha de Inicio

Vie. 01 de Dic de 2017

Horarios

Fechas:

Diciembre 1 y 2 de 2017

Horarios:

Viernes 5:00 p.m. a 9:00 p.m.

Sábado 8:00 a.m. a 5:00 p.m.

Ciudad:

Quito, Ecuador

Ciudad

Quito (Pichincha, Ecuador)

Lugar:

SOFTWARE shop

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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://software-shop.com/formacion/politicas

Inscríbete ahora