

Nombre del Curso:	Gestión de Riesgos con apoyo de Risk Simulator
--------------------------	---

INFORMACION DEL CURSO

Introducción:	Risk Simulator lo ayudará a identificar, cuantificar y valorar el riesgo de sus proyectos o sus decisiones, en este curso aprenda las principales herramientas que este software ofrece para gestión de riesgos
Dirigido a:	Este entrenamiento está dirigido a personas interesadas en control de riesgo y modelación que deseen cubrir el marco teórico del área sin exponerse de una manera extensa a los detalles de complicados modelos matemáticos, pero obteniendo avanzados resultados en términos estadísticos y financieros.
Objetivo general:	Al finalizar el curso el participante estará en capacidad de manejar las principales herramientas de risk simulator para gestión de riesgos.

CONTENIDO DEL CURSO

Simulación de Montecarlo con Risk Simulator:

1. Análisis de Simulación de Montecarlo.
2. Correlacionar y Truncar Distribuciones.
3. Alternar Parámetros y Simulaciones Multidimensionales.
4. Ajuste de Distribuciones.

Optimización con Risk Simulator:

1. Optimización Continua.
2. Optimización Discreta.
3. Optimización Estocástica.

Pronósticos con Risk Simulator:

1. Pronósticos de Series de Tiempo.
2. Análisis de Regresión Multivariado.
3. Box Jenkins ARIMA.
4. Procesos Estocásticos.

Árboles de Decisión con Risk Simulator:

1. ¿Cómo construir un Árbol de Decisión?
2. Diseño del Árbol de Decisión.
3. Introduciendo Incertidumbre a un Árbol de Decisión.
4. Tomando Decisiones usando Árboles de Decisión

Gestión de Riesgo de Mercado:

1. Metodología de Duración, Duración modificada y Sensibilidad.
2. Riesgo de Convexidad.
3. Cálculo del VaR.
4. Metodologías para la Medición del VaR: Delta Normal, Simulación Histórica, Montecarlo.

5. Modelo de Optimización de Portafolio de Acciones. 6. Simulación de Brechas de Liquidez, Tasa de Interés. Gestión de Riesgo de Crédito: 1. Modelo de Scoring a. Modelo Logit. 2. Cálculo de Probabilidades de Default. 3. Pérdidas Esperadas, Pérdidas Inesperadas. 4. Cálculo del Credit-VaR. 5. Matrices de Transición	
Gestión de Riesgo Operacional: 1. Modelo de Severidad de Pérdidas 2. Modelo de Frecuencia de Pérdidas 3. Evaluación de Controles 4. Modelación de la BD de Pérdidas 5. Cálculo del Operational VaR	
Metodología:	El Profesor se convierte en un facilitador y las clases se desarrollan sobre la base de discusiones, resolución de casos y participación activa. <u>Cada alumno dispondrá de un computador para sus practicas.</u>
Materiales:	<ul style="list-style-type: none"> • Material de apoyo • Certificado de asistencia al curso
Duración:	20 horas

Contáctenos,