



IMF CONSULTING SAC
MICROFINANZAS & COOPERATIVAS

RISK-13: MODELOS ECONOMETRICOS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO UTILIZANDO RISK SIMULATOR

OBJETIVO:

El participante podrá desarrollar modelos econométricos conforme a las buenas prácticas de gestión de riesgos, elaboradas por la Superintendencia de Banca y Seguros (SBS) y los principios de riesgos internacionalmente aceptados (GARP), utilizando el software Risk Simulator. Este taller está dirigido a los miembros de las organizaciones con funciones y responsabilidades relacionadas a la gestión de los riesgos financieros y no financieros de la empresa.

TEMARIO:

Fundamentos de Estadística para la Gestión Integral de Riesgos

- Estadística Descriptiva: Indicadores de Tendencia Central e Indicadores de Dispersión
- Teoría de probabilidades, Bayes, Variables aleatorias, Combinaciones y Permutas
- Distribuciones de Probabilidad: Discreta y Continuas. Teorema de Limite Central
- Estadística Inferencial, Muestreo Estadístico y Prueba de Hipótesis. Error tipo I y II.
- Introducción a la Econometría: Modelo Lineal y General de Mínimos Cuadrados. Supuestos.

Fundamentos de la Modelación Econométrica con Risk Simulator

- Introducción al Software.
- MS Excel y Risk Simulator
- Risk Simulator como complemento
- Versiones del software
- Ventajas respecto a otros simuladores
- Requerimientos de Hardware y Software
- Manejo de la barra de herramientas Risk Simulator
- ¿Qué es un modelo?
- ¿Qué es una simulación?
- Pasos en el desarrollo de un modelo con Risk Simulator
- Seleccionando una distribución

Contacto: Mauro Alva Neyra. **WhatsApp:** [+51 990891183](tel:+51990891183)

Email: malva@imfconsultingsac.com | gerencia@imfconsultingsac.com

Web: www.imfconsultingsac.com



IMF CONSULTING SAC
MICROFINANZAS & COOPERATIVAS

- Introducción al BestFit
- ¿Qué es la Simulación Montecarlo? (Ej. VPN en MS Excel)

Ejercicio práctico.

- Preparando un modelo de simulación
- Definición de supuestos
- Correlación de supuestos
- Definición de pronósticos
- Editando los datos de Risk Simulator

Modelamiento de la Gestión de Riesgo de Crédito con Risk Simulator

- Modelos de SCORING: Modelos Logit y Modelos Probit
- Cálculo de Probabilidades de Default
- Cálculo de Matrices de Transición y Análisis por Cosechas
- Pérdidas Esperadas y Pérdidas No Esperadas. CVar

Modelamiento de la Gestión de Riesgo de Mercado con Risk Simulator

- Qué es el Modelo de Valor en Riesgo (VaR)?
- Metodologías utilizadas en la medición del VaR: Delta-normal, Simulación Histórica, Monte Carlo
- Modelo de Portafolio de Acciones
- Modelo de Optimización Estocástica

Modelamiento de la Gestión de Riesgo Operacional con Risk Simulator

- Sistematizando el Estándar Australiano y el COSO ERM para riesgo operacional
- Modelos de Severidad de Pérdida
- Identificación de la mejor distribución
- Modelos de Frecuencia de Pérdida
- Funciones de Probabilidad Discreta
- Funciones Truncadas

DURACION:

Contacto: Mauro Alva Neyra. **WhatsApp:** [+51 990891183](https://wa.me/51990891183)
Email: malva@imfconsultingsac.com | gerencia@imfconsultingsac.com
Web: www.imfconsultingsac.com