



**GRACIAS AL ÉXITO ALCANZADO EN CURSOS ANTERIORES Y
A LA DEMANDA EXISTENTE, PRESENTA EL**

TALLER PRÁCTICO:
**“INTRODUCCIÓN AL MANEJO DE SERIES DE
TIEMPO Y OTRAS METODOLOGÍAS
CUANTITATIVAS, APLICACIÓN DE MODELOS
DE SIMULACIÓN (@RISK) E INTRODUCCIÓN AL
USO DE REDES NEURONALES”**

-TALLERES PRÁCTICOS POR 20 HORAS-

TEMA PRINCIPAL A TRATARSE: **EXPLICACIÓN PASO A PASO DE LAS METODOLOGÍAS MÁS AVANZADAS UTILIZADAS EN LA GESTIÓN DE RIESGOS FINANCIEROS, EN UN CURSO EMINENTEMENTE PRÁCTICO.**

DIRIGIDO A: Gerentes Generales de Instituciones Financieras, Asesores Financieros, Auditores, Jefes de Operaciones, Tesoreros, Jefes de Riesgos y Analistas responsables de medir, supervisar, interpretar y reportar riesgos.

OBJETIVOS:

- **Comprender PASO A PASO, de modo 100% PRÁCTICO; los principales modelos necesarios en la moderna gestión de riesgos financieros.**
- **Los estudiantes ejercitarán y reforzarán los conocimientos adquiridos mediante la realización de ejercicios dentro del taller y en asignaciones semanales, a su propio paso.**
- **Al finalizar el curso los participantes podrán implementar de forma práctica e inmediata los modelos aprendidos.**

TEMARIO DETALLADO

INTRODUCCIÓN AL MANEJO DE SERIES DE TIEMPO Y OTRAS METODOLOGÍAS CUANTITATIVAS

- Uso de simulación de Monte Carlo para predicción.
- Uso de Modelos GARCH para complementar el Análisis de la Volatilidad.
- Modelos de volatilidad dinámica y con suavizamiento exponencial.
- Método RMSE y elaboración de mejores pronósticos.
- Construcción de modelos ARMA y ARIMA.
- Aplicabilidad en los depósitos monetarios y otras series clave en riesgos de mercado y liquidez.

APLICACIÓN DE MODELOS DE SIMULACIÓN (@RISK) E INTRODUCCIÓN AL USO DE REDES NEURONALES

- Análisis de principales modelos de simulación utilizados en riesgos de mercado y liquidez, crédito y operativo.
- Identificación de distribuciones de severidad: Weibull, Pareto; Exponencial y otras.
- Identificación de distribuciones de frecuencia: Bernoulli, Binomial, Hipergeométrica y otras.
- Uso de la distribución Poisson: simulación de Pérdidas Totales.
- Introducción al uso de modelos de redes neuronales en la predicción de fraudes, incumplimientos y quiebras.
- Ejemplos con bases de datos reales utilizando paquetes profesionales (@Risk).



INSTRUCTOR:

Enrique Navarrete
(México)

M.Sc. en Economía, University of Chicago (USA)
B.Sc. en Economía, MIT, (USA)
B.Sc. en Matemáticas, MIT, (USA)

Matemático y Economista de nacionalidad **mexicana**, cursó sus estudios universitarios tanto en matemáticas puras como en economía en el **M.I.T. (Massachusetts Institute of Technology)**.

Sustentó su Tesis sobre “La Productividad del capital público”, que fue supervisada por el Profesor Robert M. Solow (Premio Nobel de Economía, 1987). Posee una maestría en la **Universidad de Chicago**.

Consultor de derivados y riesgo financiero en instituciones del sector público y privado. Trabajó en el **Grupo Financiero Popular** en las áreas de **tesorería y Derivados**, realizando trading de derivados y desarrollando nuevos productos para el área andina (Colombia, Ecuador, Perú y Venezuela).

Actualmente es **Presidente de Scalar Consulting**, compañía especializada en la **medición, administración y cobertura de riesgos financieros** (www.grupoescalar.com).

Ha asesorado a diversas instituciones tales como **bancos multisectoriales, bancos estatales y de desarrollo, cajas municipales de ahorro y crédito, sociedades financieras, cooperativas, emisoras de tarjetas de crédito, etc.** En la implementación de sistemas de medición y gestión de riesgos, especialmente **riesgo de mercado, liquidez, crédito y riesgo operativo**.

Durante el periodo 2002 – 2008 ha dictado **más de 100 seminarios** en Latinoamérica sobre riesgos financieros, como por ejemplo en las Superintendencias de Bancos de **República Dominicana, Bolivia y Ecuador**, así como en bancos tales como **Banco de Crédito del Perú, Banco del Pichincha, Lloyds Bank, y Banco Santa Cruz**, entre otros.

Profesor de la **Universidad de las Américas (UDLA)**, catedrático invitado por la **FLACSO** en la Maestría de Economía así como por la **Escuela Politécnica Nacional** en las **Maestrías de Estadística e Investigación de Operaciones**.

Diseñó la “**Maestría en Gestión de Riesgos Financieros**” ofrecida actualmente en la Escuela Politécnica Nacional, donde también imparte cátedra.



Autor de software para la medición y gestión de riesgos: tipo de cambio, tesorería, mercado, crédito, liquidez y operativo, utilizando metodologías como *Asset & Liability Management (ALM)*, *Valor en Riesgo (VaR)* y simulación.

Actualmente colabora en un proyecto del **Banco Interamericano de Desarrollo (BID)** sobre la implementación de **Basilea II en instituciones microfinancieras**.

LUGAR Y FECHAS:

Quito

Centro de Capacitación de Scalar Consulting

Octubre 22, 23 y 24 de 2008

Horarios:

Miércoles	14h00 – 21h00
Jueves	14h00 – 21h00
Viernes	09h00 – 15h00

DURACIÓN: 20 horas

INCLUYE COFFE BREAKS, MATERIAL, ASÍ COMO CERTIFICADO DE ASISTENCIA

CUPOS LIMITADOS !!!