



Riesgo Operacional (RO)

Medición Avanzada RO

El curso está dirigido a profesionales cuyo ejercicio esté relacionado con la administración de riesgos (en el sector financiero o la academia) y gerentes o responsables de procesos o funciones que deseen administrar los riesgos inherentes a las tareas que supervisan.

TEMAS

1. Enfoques de instrumentación de los Modelos de Medición Avanzada.

- 1.1.- Scorecards
- 1.2.- Medición interna
- 1.3.- Modelos estadísticos

2. Componentes de un sistema de medición avanzada del riesgo operativo

- 2.1.- Autoevaluación del entorno y del control interno
- 2.2.- Análisis de escenarios
- 2.3.- Estadísticas internas de pérdida por riesgo operativo
- 2.4.- Estadísticas externas de pérdida por riesgo operativo

3.- Enfoque Scorecard para la medición del riesgo operativo

- 3.1.- Definición y características de los indicadores clave de riesgo
- 3.2.- Descripción de la metodología
- 3.3.- Mapeo de riesgos
- 3.4.- Scorecard - Definición de umbrales y límites
- 3.5.- Score de actividades y líneas de negocio
- 3.6.- Cálculo del requerimiento de capital

4. Modelos Estadísticos

- 4.1.- Pérdida esperada y no esperada
- 4.2.- Distribuciones de probabilidad para la frecuencia (Poisson, binomial negativa, binomial, geométrica, otras distribuciones)
- 4.3.- Distribuciones de probabilidad para la severidad (Normal, lognormal, exponencial, Pareto, combinación de distribuciones, otras distribuciones)
- 4.4.- Pruebas a los ajustes de las distribuciones:
 - Pruebas gráficas
 - Pruebas analíticas
- 4.5.- Estimación del Valor en Riesgo Operativo VaR por simulación montecarlo
 - Generación de la distribución de pérdidas anuales por riesgo operativo.
 - Pérdida esperada y no esperada
 - Valor en Riesgo Operativo

5. Distribuciones de probabilidad de valores extremos aplicada a la medición del riesgo operativo

- 5.1.- Introducción a la teoría de valores extremos
- 5.2.- Distribución de valores extremos (GEV)
 - Estimación por máxima verosimilitud
 - Estimación por momentos ponderados
- 5.3.- Distribuciones de Pareto Generalizada (GPD)
 - Estimación por máxima verosimilitud
 - Estimación por momentos ponderados
- 5.4.- Aplicación a la severidad de las pérdidas
- 5.5.- Ajuste de dos o más distribuciones para la severidad de las pérdidas.

Curso 100% Práctico con R y Excel



Docente



Actuario por la UNAM de México y con maestría en ciencias por el Imperial College of Science Technology and Medicine. Socio fundador de Numeravi Valuación y Análisis de Riesgos (México), experto con mas de 20 años de experiencia desarrollando e implementando modelos de riesgo de crédito, mercado y operacional (marcos normativos de Basilea y Solvencia). Asimismo, cuenta con experiencia docente (profesor de la maestría en Finanzas en la UNAM de México).

