

1. INFORMACIÓN GENERAL

Nombre Programa:	Riesgo Financiero para Quants y Ejecutivos
Tipo de programa:	Curso
Duración:	24 horas

Público objetivo:
Este curso está diseñado para proporcionar a profesionales financieros, analistas cuantitativos (Quants) y ejecutivos una comprensión de los conceptos y técnicas cuantitativas fundamentales, metodologías y herramientas avanzadas relacionadas con la gestión de riesgos financieros en entornos empresariales complejos y dinámicos.

Justificación:
La gestión del riesgo financiero ocupa un lugar primordial en instituciones financieras e involucra la consideración de consecuencias y lecciones que nos han dejado pasadas y actuales crisis financieras. Lo anterior permitirá mitigar la materialización de posibles riesgos en el futuro. La gestión debe realizarse de acuerdo con normas internacionales de gestión de riesgos, y más propiamente por las regulaciones de Basilea.
Los temas que trata el curso son análisis riesgo-retorno, crisis crediticia, regulación actual de Basilea, VaR, CVaR, back-testing, impactos en reservas, probabilidad de impago, y reflexiones sobre eventos extremos.

Objetivo general:
Analizar metodologías de gestión de riesgos financieros en las organizaciones desde una perspectiva conceptual, cuantitativa y ejecutiva, con el fin de prever impactos en los negocios y de presentar decisiones argumentadas.

Objetivos específicos:

- 1 Discutir elementos conceptuales sobre medición y gestión de riesgos, y sobre lecciones que han dejado pasadas crisis financieras.
- 2 Analizar metodologías para valorar riesgos de mercado y crédito en portafolios de instrumentos financieros.
- 3 Contextualizar la gestión del riesgo financiero bajo elementos regulatorios y de toma de decisiones bajo incertidumbre.

2. ESTRUCTURA

Módulos	Temas	Intensidad horaria
MÓDULO I	1.1 Análisis Riesgo vs Retorno en un portafolio de activos.	8 horas

<p align="center">INTRODUCCIÓN</p>	<p>1.2 Crisis crediticia 2007-2009 – lecciones Prácticas cuantitativas en gestión de riesgos 1.3 Impactos en ambientes inciertos de tasas de interés</p>	
<p align="center">MÓDULO II RIESGO MERCADO Y CRÉDITO</p>	<p>2.1 Modelos simples de mercado para medir la volatilidad de un activo 2.2 Conceptos Valor en Riesgo y Valor en Riesgo Condicional 2.3 Métodos y retos para estimar el valor en riesgo 2.4 Probabilidad de impago de una compañía – Alternativas de estimación</p>	<p align="center">8 horas</p>
<p align="center">MÓDULO III REGULACIÓN DE BASILEA, CISNE NEGRO Y TOMA DE DECISIONES</p>	<p>3.1 Conceptos fundamentales en la regulación de Basilea 3.2 Retos en la implementación de la regulación 3.3 Eventos extremos, sicología y mercado financiero en el cisne negro 3.4 Toma de decisiones – caso: pruebas de tensión para el VaR</p>	<p align="center">8 horas</p>

3. METODOLOGÍA

La formación se llevará a cabo de manera virtual mediante una plataforma proporcionada por la empresa SERfinanciero S.A.S. A través de esta, los participantes tendrán la oportunidad de interactuar virtualmente en tiempo real, permitiéndoles realizar consultas al formador de manera directa. Se darán clases teóricas impartidas por el experto en gestión de riesgos financieros y análisis cuantitativo, incluye sesiones prácticas con ejercicios de modelado, análisis de datos y simulaciones. Estudios de casos basados en situaciones reales del mercado y escenarios de riesgo empresarial, uso de herramientas y software especializados para el análisis y la gestión de riesgos financieros.

Nota: Se requiere un conocimiento sólido en matemáticas, estadísticas y finanzas cuantitativas. Se recomienda experiencia previa en análisis financiero, modelado de riesgos y uso de herramientas y software de análisis cuantitativo.