VALUARTIK

METODOLOGÍAS DE VAR Y BACKTESTING

[WEBINAR] Metodologías de VAR y Backtesting para aseguradoras

Lyntik Corporate Blog • lyntik.co

El 9 de octubre presentamos nuestro **webinar gratuito** enfocado en los desafíos actuales de las aseguradoras, especialmente en la implementación del **Sistema Integrado de Administración de Riesgos (SIAR)** y las metodologías clave de gestión de riesgos como el **Valor en Riesgo (VaR)** y el **Backtesting**. Con la destacada participación de **Diego Luis Álvarez Montoya**, cofundador de **Amautas Analytics**, se ofrecieron soluciones prácticas para enfrentar estos desafíos y automatizar el proceso de administración de riesgos utilizando tecnología avanzada.

Plazos Clave: Implementación del SIAR y Normativas Futuras

Durante el webinar, se destacó la urgencia de que las aseguradoras implementen su **SIAR** antes de diciembre, un requisito indispensable para cumplir con las regulaciones. Además, se discutieron las normativas que entrarán en vigor en **agosto del próximo año**, relacionadas con las **grandes exposiciones y la concentración de riesgos**, lo que representa un reto crucial para las empresas del sector.

Principales Temas Abordados

1. Valor en Riesgo (VaR) y Backtesting

La medición del **Valor en Riesgo (VaR)** y su validación mediante **Backtesting** son fundamentales para una gestión efectiva del riesgo. Se abordaron diferentes metodologías de cálculo, incluyendo el **VaR paramétrico**, la **Simulación Histórica** y la **Simulación de Montecarlo**. Estas herramientas permiten a las aseguradoras estimar la **máxima pérdida esperada** bajo condiciones de mercado normales, ayudando a tomar decisiones más informadas.

2. Evolución en la Medición del Riesgo de Mercado

Los participantes también exploraron conceptos avanzados como:

- **Duración y Duración Modificada**: Indicadores que miden la sensibilidad del valor de un activo ante cambios en las tasas de interés.
- **Convexidad**: Un ajuste clave para medir cómo cambia la duración cuando hay fluctuaciones significativas en las tasas de interés.
- **Enfoque Gap y Descalce**: Para entender las diferencias entre los activos y pasivos a lo largo del tiempo y su impacto en el riesgo.

3. Automatización del SIAR con Mark Risk Valuartik

Un tema central fue cómo **Mark Risk Valuartik**, una solución tecnológica avanzada, facilita la implementación y gestión del **SIAR** de manera automática. Esta herramienta permite a las aseguradoras optimizar su administración de riesgos, reducir el margen de error y mejorar el cumplimiento de las normativas vigentes sin la necesidad de procesos manuales extensivos.

La Importancia de la Tecnología en la Gestión de Riesgos

Uno de los puntos más importantes del webinar fue el papel de la tecnología en la administración de riesgos. **Diego Álvarez** explicó cómo herramientas como **Mark Risk Valuartik** no solo mejoran la eficiencia operativa, sino que también permiten una mayor precisión en la evaluación y gestión de riesgos, algo fundamental para cumplir con los plazos regulatorios y mantenerse competitivo en el mercado.

¿Te Perdiste el Webinar? Repasa los Puntos Clave

Si no pudiste asistir al webinar o quieres revisar los temas discutidos, también puedes descargar el recurso de la presentación ***(TEST KUPIEC y Chi2 20241009)***. Mantenerte informado y actualizar tus procesos de gestión de riesgos es crucial para el éxito de tu organización en el entorno regulatorio actual.

Solicita un Demo Gratuito de Valuartik

¿Quieres saber cómo **Mark Risk Valuartik** puede transformar la administración de riesgos en tu firma? Solicita un **demo gratuito** y descubre cómo esta solución puede ayudarte a implementar tu SIAR de manera automática y eficiente. Visita www.valuartik.com para obtener más información y mantener tu organización a la vanguardia de la gestión de riesgos.

Descarga la presentación aquí:

Presentación Valuartik