



Descriptivo

# Estrategia de Modelación de Riesgos Financieros, Decisiones de Inversión y Procedimientos para la modelación de Series de Tiempo

## Descripción:



### Dirigido a:

Directivos y Analistas Financieros, de Tesorerías, Crédito, Liquidez, Mercados, Operaciones, Evaluación de Proyectos, Costos, Presupuestos, Producción, Compras, Planeación en sectores como Energía, Hidrocarburos, Gas, Minería, Banca, Seguros, Servicios Financieros, Educación, Infraestructura entre otros.



### Objetivo:

Mostrar a los participantes la importancia del uso de Técnicas Estadísticas para la Modelación de Riesgos Financieros, Estrategias de Evaluación de Proyectos y Procedimientos para la Modelación de Series de Tiempo apoyados en el uso de herramientas informáticas especializadas para dichos temas.



### Temario:

#### **Procedimiento para la Modelación de Series de Tiempo con STATA:**

Estacionariedad y Conceptos Previos  
Modelos Univariantes: AR, MA, ARMA  
Análisis de las Funciones de Autocorrelación Simple y Parcial  
Estacionalidad - Modelos Integrados - Raíces Unitarias  
Metodología de Box Jenkins

#### **Modelación de Riesgos de Crédito con RISK SIMULATOR:**

Fundamentos Estadísticos para el Manejo de Modelos de Riesgo  
Técnicas Tradicionales de Modelación de Riesgos  
Método de Simulación de Montecarlo.  
Modelos Scoring: Uso de Modelos LOGIT

#### **Estrategias de Evaluación de Proyectos con PEAT:**

Estrategias de construcción de Presupuestos  
Técnicas de Evaluación de Proyectos  
Optimización de Cartera de Proyectos de Inversión  
Inclusión de Opciones Reales en la Evaluación de Proyectos



### Instructores: