

# Entrenamiento Especializado

## Entrenamiento especializado vía web: Risk Simulator en el Análisis Financiero y de Riesgo

### Descripción

El entrenamiento abierto y a distancia (Online), aborda desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo ofreciendo al participante herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la administración y gestión del riesgo. Al finalizar este entrenamiento los participantes manejarán los conceptos y técnicas necesarios para llevar a cabo un análisis de riesgo para la posterior toma de decisiones. Se presentarán ejemplos como: -Flujo de Caja -VPN y TIR -Optimización de Portafolios de Inversión - Cálculo del VaR por Monte Carlo -Cálculo de probabilidades de incumplimiento

### Dirigido a

El entrenamiento está dirigido a profesionales en economía, administración, finanzas, contaduría e ingeniería; a personas interesadas en temas de identificación, medición y control de riesgo, para la toma de decisiones financieras, económicas y gerenciales. En general, a quienes deseen cubrir el marco teórico del área, sin exponerse de manera extensa a los detalles complicados de modelos matemáticos, logrando habilidades que les permitan desempeñarse de forma más eficiente y eficaz en el mundo del riesgo, pronóstico y optimización.

### Objetivo

El objetivo primordial es llevar al asistente por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico para lograr una mayor contextualización, manejo, modelación, medición y administración del riesgo. Analizar e interpretar resultados estadísticos de manera gráfica y numérica. Aplicación de temas financieros y económicos con RISK SIMULATOR, como herramienta de apoyo para la toma de decisiones.

### Temario

#### 1. Fundamentación

- a. Estadística Descriptiva
- b. Probabilidad y Variables Aleatorias
- c. Teorema Central del Límite (Conceptos Básicos)
- d. ¿Qué es la Simulación de Montecarlo? (Ej VPN en MS Excel)

#### 2. Introducción al Software

- a. Aplicaciones Generales
- b. Manejo de los menús

#### 3. Simulación de Monte Carlo

- a. Simulación de Monte Carlo e Hipercubo Latino
  - b. Variables de entrada y pronóstico
  - c. Edición de variables
  - d. Ajuste de Distribución Automático y pruebas de bondad de ajuste
    - i. Variables continuas
    - ii. Variables discretas
  - e. Preferencias de la simulación y nivel de precisión
  - f. Ejecución del modelo
  - g. Análisis de las estadísticas de simulación
  - h. Análisis Tornado, Araña y de Sensibilidad
  - i. Sobreposición de variables
  - j. Correlación de supuestos
- Ejemplo de Simulación de Ventas, Ajuste de Distribución de Producción, Ingresos, Compras, Precios, Commodities.

#### 4. Introducción al Riesgo

- a. Tipos de Riesgo
- b. Importancia del análisis de variables
- c. Gestión del Riesgo

## 5. Riesgo de Crédito con Risk Simulator

- a. Análisis de modelos LOGIT
- b. Cálculo de probabilidades de default
- c. Pérdidas Esperadas

## 6. Riesgo de Mercado con Risk Simulator

- a. Value at Risk (VaR)
- b. Metodologías de medición del VaR.
- c. Utilización de la simulación de Montecarlo en el cálculo del VaR

## 7. Optimización

- a. Optimización de Portafolios usando Risk Simulator
- b. Optimización estática, dinámica y estocástica
- c. Ejercicios de optimización

## 8. Pronóstico

- a. Introducción a la Econometría
- b. Qué es Regresión?
- c. Qué son los Modelos de Series de Tiempo?
- d. Modelos Básicos de Pronóstico (Promedio Móvil Simple, Doble, Suavizamiento Exponencial, Holt Winters Estacionales)
- e. Ejercicios de Pronósticos

## Instructores

Miller Franco Lemus

Contador Público, Especialista en Ingeniería Financiera con énfasis en valoración de instrumentos financieros derivados de la Universidad Nacional de Colombia y Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CRM, impartido por el Dr. Johnathan Mun y otorgado por el Instituto IIPER. Gran experiencia en el análisis económico y financiero en los modelos de expansión, desempeñándose como Coordinador financiero del Grupo Expansión de Negocios. Amplio conocimiento y experiencia en la implementación de productos financieros derivados y de renta fija en el sector financiero colombiano. Se ha desempeñado como docente en las áreas de gestión de riesgos y derivados financieros en la Universidad Piloto de Colombia, docente de cursos de Excel avanzado y macros en la Universidad Nacional de Colombia y San Martín, además de participar como conferencista invitado en otras Universidades del país en temas relacionados con la gestión del riesgo y valoración de instrumentos financieros derivados. Actualmente se desempeña como Analista Sénior para la implementación de productos financieros derivados y de renta fija en el sector Financiero Colombiano.

## Información General

### Duración

20 horas

### Fecha de Inicio

Mar. 11 de Sep de 2012

### Horarios

Septiembre 11, 13, 15, 18 y 20 de 2012

Martes y Jueves (sesiones de 3 horas)

San José de Costa Rica 3:00 p.m.

México D.F. 4:00 p.m.

Bogotá 4:00 p.m.

Quito 4:00 p.m.

Lima 4:00 p.m.

Caracas 4:30 p.m.

Bolivia 5:00 p.m.

Santiago 6:00 p.m.  
Buenos Aires 6:00 p.m.

**Sábados (sesiones de 4 horas)**

San José de Costa Rica 8:00 a.m.  
México D.F. 9:00 a.m.  
Bogotá 9:00 a.m.  
Quito 9:00 a.m.  
Lima 9:00 a.m.  
Caracas 9:30 a.m.  
Bolivia 10:00 a.m.  
Santiago 11:00 a.m.  
Buenos Aires 11:00 a.m.



**Políticas**

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora