Entrenamiento Especializado

Fundamentación para la Gestión Cuantitativa de Riesgos.

Descripción

La toma de decisiones, desde las más básicas y rutinarias hasta las más complejas y estratégicas, hace parte de la vida diaria desde cualquiera de las dimensiones que quiera ser aproximada. Para los diferentes individuos, bien sean corporativos, financieros, gubernamentales, académicos o los involucrados con la administración y puesta en marcha de proyectos, la esencia de la toma de decisiones descansa en supuestos que se crean sobre el futuro y por ende están sujetos a incertidumbre. Poder medir y gestionar dicha incertidumbre, es decir, el riesgo es un reto que no sólo favorecerá una mejor asignación de recursos sino que minimizará las exposiciones o pérdidas en caso de que las cosas salgan mal. La Fundamentación para la Gestión Cuantitativa de Gestión de Riesgos es un entrenamiento teórico-práctico donde revisaremos, aprenderemos y practicaremos los conceptos necesarios contar con bases sólidas en posteriores profundizaciones en temas de gestión de riesgo.

Dirigido a

Profesionales, Directores, Analistas, Docentes, Investigadores y en general para todas las personas que trabajen o estén interesadas en la Implementación de Técnicas y Conceptos referentes a la Gestión Integral de Riesgos.

Objetivo

· Entender el concepto de riesgo y concientizar por qué es necesario tenerlo en cuenta para la toma de decisiones estratégicas. · Realizar un recorrido por lo fundamentales estadísticos y financieros relevantes para la gestión de riesgos. · Implementar los métodos y herramientas aprendidas para la gestión de riesgos a través de ejemplos y casos aplicados en Microsoft Excel y Risk Simulator.

· Generar las bases necesarias para cursos más avanzados o de especialización en temas específicos de riesgo incluido el CQRM® (Certified in Quantitative Risk Management)

Temario

I. El concepto de Riesgo: ¿qué es y por qué nos interesa conocerlo?

Palabras clave: Incertidumbre, riesgo, aversión, gestión, exposición, identificación, evaluación, matriz de riesgo, selección, curva de indiferencia, protección, aseguramiento, diversificación, implementación.

· Definición de riesgo
· El riesgo y las decisiones estratégicas
· Procedimiento general para la gestión del riesgo
· Transferencia del riesgo

II. Conceptos de estadística para la gestión de riesgos Palabras clave: Media, mediana, moda, cuantiles, ponderado, acotado, rango, varianza, desviación estándar, coeficiente de variación, asimetría, apuntalamiento, z-score, Chebyshev, regla empírica, covarianza, correlación, experimento, evento, probabilidad, variable aleatoria, hipótesis nula y alternativa, error tipo I y II, tamaño de la prueba, p-value.

· Medidas de localización

- Medidas de variabilidad
- Medidas de distribución y ubicación relativa
- Medidas de asociación
- Introducción a la probabilidad
- Distribuciones discretas de probabilidad
- Distribuciones continuas de probabilidad
- Pruebas de hipótesis

III. Conceptos del valor del dinero en el tiempo para la gestión de riesgos Palabras clave: Interés compuesto, fecha focal, anualidad, gradiente, raíces, interpolación, tasa de interés de oportunidad, CAPM.

- El concepto de interés
- Interés compuesto
- Descuento de flujos
- Valor Presente Neto (VPN)
- Tasa Interna de Retorno (TIR)

IV. Modelación de situaciones para la toma de decisiones y la gestión de riesgos Palabras clave: Tornado, araña, perfil, supuestos, ajustes, distribuciones, correlaciones, truncamientos, multidimensional, nivel de precisión y de error, bootstrapping, reportes, momentos, due-diligence.

- Análisis de punto único
- Análisis de escenarios
- Análisis de sensibilidad
- Análisis de simulación (Simulaciones de Montecarlo)

V. Procesos de optimización para la toma de decisiones y la gestión de riesgos Palabras clave: Objetivo, decisión, límites, restricciones, corridas, estático, dinámico, estocástico.

- Optimización estática
- Optimización dinámica
- Optimización estocástica

VI. Elaboración de pronósticos para la toma de decisiones y la gestión de riesgos Palabras clave: Tendencia, estacionalidad, irregularidad, media móvil, suavizamiento exponencial, Holt-Winters, medidas de precisión de pronóstico, MSE, RMSE, MAD, MAPE, Theil, autorregresivo, integrado, autocorrelación, criterios de información, coeficiente de determinación, estimación, parámetros, supuestos MCRL.

- Series de tiempo: componentes
- Métodos de suavizamiento
- Modelos ARIMA (Box-Jenkins)
- Modelos de regresión
- Otros modelos VII.

Opciones Reales: una alternativa para la valoración y la gestión de riesgos Palabras clave: Trampas, evaluación, proyectos, aplazar, expandir, abandonar, cambiar, extender, incertidumbre, riesgo neutral, binomial.

- Qué son las opciones reales y por qué utilizarlas
- Valoración de proyectos con opciones reales
- Valoración de opciones reales interrelacionadas

Instructores

Julián Andrés Meléndez Cardona

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartido por el Dr. Johnathan Mun y otorgado por el Instituto IIPER. Economista con Especialización en Gerencia de Mercadeo de la Universidad Externado de Colombia. Cuenta con amplia experiencia en temas de Valor de Dinero en el Tiempo y en Análisis y Planeación Financiera de entidades en los sectores Financiero y Real. En el campo académico trabajó como docente en temas de Econometría y Finanzas en la Universidad Externado de Colombia y en la Fundación Universitaria Los Libertadores. Actualmente se desempeña como Gerente de Producto del Portafolio Cuantitativo de SOFTWARE shop para Latinoamérica.

Información General

Duración

20 Horas

Fecha de Inicio

Lun. 16 de Feb de 2015

Horarios

Fechas:
Febrero 16, 17, 18, 19 y 21 de 2015

Martes a Viernes
Horario:
1:30 p.m. a 5:30 p.m.

Sábado
Horario:
8:30 a.m. a 12:30 m.

Ciudad

Bogotá (Bogotá, Colombia)

Lugar:

SOFTWARE shop

Herramientas de apoyo



Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

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