Taller

Taller Presencial: 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

Fernando Jáuregui Puertas

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos CRM, impartida con el Dr.

Jonathan Mun. Profesional en Ciencias Económicas de la Universidad Nacional de Ingeniería del Perú. Executive Master in Financial Analysis en la Universidad Carlos III de Madrid (España). Adicionalmente, cuenta con especialización en Gestión de Riesgos Financieros en BURSEN (Centro de Estudios Bursátiles de la Bolsa de Valores de Lima) y en Formulación y Evaluación de Proyectos de Inversión Pública en la Universidad ESAN. Actualmente es docente de la Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico (Perú) e instructor de SOFTWARE shop para LATAM. Tiene experiencia en el sector público como Analista de Proyectos de Inversión y en el Sector Bancario como Analista de Estudios Económicos. Anteriormente se desempeñó como docente de la Facultad de Ingeniería Económica de la Universidad Nacional de Ingeniería (Perú), en las asignaturas de Econometría II y Análisis de Series Temporales.

Información General

Duración
3 horas

Fecha de Inicio
Jue. 20 de Ago de 2015

Horarios
Fecha:
Agosto 20 de 2015

Horario:
9:00 a.m. a 12:00 m.

Lugar:
Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas
Sede San Isidro
Laboratorio B-404

Ciudad
Lima (Lima, Perú)

Lugar:
Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas Sede Isidro

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