

# Entrenamiento Especializado

CQRM - Certificación Internacional en Administración de Riesgo Cuantitativo Virtual Caracas  
2016

## Descripción

**Ventajas claves de atender este seminario:**

- Obtener la Certificación Internacional como Administración de Riesgo (CRM-IIPER).
- Aprender de un verdadero experto mundial en el campo, con las mejores credenciales y experiencia práctica.
- Obtenerlo directamente de la fuente original. El instructor del Seminario, es Doctor en finanzas y economía; es consultor de más de 100 multinacionales y es conocido mundialmente por su expertis y experiencia en análisis de riesgo y Opciones Reales.
- Se brinda por medio de este curso un acercamiento básico pero profundo a los planteamientos teóricos necesarios con los que se debe contar para la administración del riesgo; además, la fusión entre Risk Simulator y Excel da la posibilidad para cualquier usuario de poder interactuar con el software sin mayores complicaciones.
- Aprenderá a manejar una herramienta capaz de analizar grandes volúmenes de información y que además cuenta con los mejores métodos teóricos para poder estar en la vanguardia tanto técnica como teórica. En la herramienta Risk Simulator encontramos la vinculación perfecta entre máquina y teoría.
- No es necesario contar con conocimientos demasiado avanzados, ni niveles de estudio altos para poder participar en el seminario CRM, ya que se brinda por medio de este curso, un acercamiento básico pero profundo a los planteamientos teóricos necesarios con los que se debe contar para la administración del Riesgo; además, la fusión entre Risk Simulator y Excel da la posibilidad para cualquier usuario de poder interactuar con el software sin mayores complicaciones.
- Aplicabilidad de conocimientos en áreas como: Hidrocarburos, construcción, hidroeléctricas, sector financiero, Gobierno, aseguradoras, academia, investigación, entre otras.
- A través de este CRM, el participante podrá realizar análisis profundos para comprender el pasado, el presente y pronosticar el futuro.
- Podrá obtener mejores resultados en los negocios, ya que aprenderá a tomar decisiones en momentos de incertidumbre.
- Obtener documentación amplia sobre los temas de administración de riesgo que se tratan en el Seminario.
- Licencia de los 3 programas de Software (Risk Simulator, Real Options SLS y Modeling Toolkit ) por 90 días sin costo.

## Dirigido a

Directivos y Analistas Financieros, de Tesorerías, Crédito, Liquidez, Mercados, Operaciones, Evaluación de Proyectos, Costos, Presupuestos, Producción, Compras, Planeación, etc., en sectores como: Energía, Hidrocarburos, Gas, Minería, Acueductos, Química, Medio ambiente, Defensa, Transporte, Banca, Seguros, Servicios financieros, Infraestructura, Ingeniería, Manufactura, Comercial al por mayor y al Detal, Ganadería, Alimentos, Construcción, Turismo, Aviación, etc. También a Profesores y estudiantes de posgrados interesados en estas áreas.

## Objetivo

Después de atender la certificación los participantes analizarán, desarrollarán, sabrán leer los datos para la Medición de Riesgo, entenderán los resultados arrojados por los modelos y podrán sugerir y tomar decisiones basados en la Optimización y Opciones Reales aplicables a sus proyectos.

Aprenderán las bases teóricas y las aplicaciones prácticas en el análisis de Riesgo. En tan solo cuatro días, el Dr. Mun convierte a un asistente sin conocimientos demasiado avanzados en riesgo en un **Profesional Experto Certificado en Administración de Riesgo**, con un altísimo nivel de conocimiento, para tomar decisiones críticas en momentos de incertidumbre.

Tras la finalización del seminario y de la realización y aprobación de una prueba escrita de respuestas múltiples administrada el último día, a los participantes se les otorgará la Certificación Internacional en Administración del Riesgo CQRM.

## Temario

### MÓDULO 1: Introducción al Análisis de Riesgo

Capítulo 1: Introducción al Entrenamiento

Capítulo 2: Como se hacen las decisiones en los negocios?

Capítulo 3: Que es Riesgo/Porqué hay que considerarlo?

Capítulo 4: Vista general de Aplicaciones Software de Análisis de Riesgo

## **MÓDULO 2: Simulación Monte Carlo con Risk Simulator**

Capítulo 1: Vista General de Risk Simulator Software  
Capítulo 2: Perfiles, Supuestos, Pronósticos y Simulaciones  
Capítulo 3: Interpretación de las Estadísticas de Pronósticos  
Capítulo 4: Preferencias de Simulación y Valores Semilla  
Capítulo 5: Ejecución de Reportes, Guardar Archivos y Extracción de Datos de la Simulación

## **MÓDULO 3: Técnicas Avanzadas de Simulación**

Capítulo 1: Correlacionar y Truncar la Distribución  
Capítulo 2: Alternar Parámetros  
Capítulo 3: Simulaciones Multidimensionales  
Capítulo 4: Ajuste de Distribuciones  
Capítulo 5: Debida Diligencia y Errores en la Simulación

## **MÓDULO 4: Herramientas Analíticas y de Simulación**

Capítulo 1: Análisis Tornado y Graficas Araña  
Capítulo 2: Análisis de Sensibilidad Dinámica  
Capítulo 3: Prueba de Hipótesis para Diferentes Distribuciones  
Capítulo 4: Simulación Bootstrap No-Paramétrica

## **MÓDULO 5: Optimización con Risk Simulator**

Capítulo 1: Introducción a la Optimización  
Capítulo 2: Optimización Continua  
Capítulo 3: Optimización Entera

## **MÓDULO 6: Pronósticos**

Capítulo 1: Técnicas de Pronósticos y Tipos de Datos  
Capítulo 2: Pronósticos sin Datos  
Capítulo 3: Análisis de Pronósticos de Series de Tiempo  
Capítulo 4: Extrapolación No Lineal  
Capítulo 5: Análisis de Regresión Multivariado  
Capítulo 6: Procesos Estocásticos  
Capítulo 7: Box-Jenkins ARIMA

## **MÓDULO 7: Análisis de Opciones Reales: Teoría y Entorno**

Capítulo 1: Introducción a Opciones Reales: Qué, Donde, Quién, Cuándo, Cómo y Porqué?  
Capítulo 2: Ejemplos de Casos de Negocios Aplicados  
Capítulo 3: Vista General de Diferentes Técnicas de Valoración de Opciones: Comparación entre opciones financieras y reales  
Capítulo 4: Técnica de Probabilidad Neutral al Riesgo  
Capítulo 5: Opciones European y American Call  
Capítulo 6: Utilizar Microsoft Excel Para solucionar una opción European y American Call  
Capítulo 7: Solución de opciones básicas de Abandono, Expansión, Contracción y Alternativas

## **MODULE 8: Análisis de Opciones Reales: Aplicación de SLS Software**

Capítulo 1: Vista General de Módulos SLS y Estimación de la Volatilidad  
Capítulo 2: Estimación de la Volatilidad  
Capítulo 3: Solución de Opciones con Entradas Cambiantes y Opciones Exóticas Personalizadas  
Capítulo 4: MSLS: Múltiples opciones compuestas secuenciales  
Capítulo 5: MNLS: Solución de Reversión a la Media, Difusión de Salto y Opción Arcoíris sobre Activos Duales utilizando Arboles Trinomiales, Tetranomiales y Pentanomiales  
Capítulo 6: Enmarcar Opciones Reales

## **Instructores**

Dr. Johnathan Mun - Ph.D., MS, MBA, BS, CRM, FRM, CFC, MIFC

Doctor en Finanzas y Economía, especializándose en modelos de decisión, riesgo, econometría y análisis cuantitativo. MBA en administración, MS en administración de operaciones, Licenciado en biofísica, y posee las certificaciones: CQRM, FRM, MIFC. Autor de 22 libros, 23 patentes, 50 artículos publicados en revistas académicas y más de 200 documentos técnicos. Desarrollador de aplicaciones para la Gestión Integral de Riesgos y la toma de decisiones: Simulación de Monte Carlo, Pronóstico y Predicción, Opciones Reales, Optimización. Ha impartido seminarios a nivel mundial (Nueva York, San Francisco, Houston, Miami, Tokio, Malasia, Singapur, Zurich, Londres, Munich, Frankfurt, París, Colombia, Perú, México, entre otros) abordando los temas de análisis de riesgo, opciones reales, simulación y optimización. Anteriormente fue vicepresidente de análisis en Decisioneering Crystal Ball, Inc., y trabajó para KPMG Consulting en Estrategias Financieras Globales realizando evaluaciones estratégicas y desarrollando opciones reales y aplicaciones de simulación. Consultor, profesor, autor, y desarrollador de software. Dr. Johnathan Mun fue el desarrollador de todas las aplicaciones de Software ROV. Profesor en varias universidades a nivel mundial (Universidad de Ciencias Aplicadas en Zurich, Suiza, Universidad Estatal de San Francisco y Universidad de Santa Clara en California).

## Información General

### Duración

32 Horas

### Fecha de Inicio

Lun. 05 de Sep de 2016

### Horarios

Seminario de preparación:

Septiembre 5, 6 , y 7 de 2016

Lunes a Miércoles 8:30 a.m. a 6:30 p.m.

**Examen:** Septiembre 8 Jueves 8:00 a.m. a 10:00 a.m.

### Ciudad

Caracas (Distrito Capital, Venezuela)

### Lugar:

SOFTWARE shop - vía web



### 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