

Entrenamiento Especializado

Fundamentación para la Gestión Cuantitativa de Riesgos.

Descripción

En este entrenamiento se abordará 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 la gestión del riesgo.

Al final del entrenamiento usted contará con información suficiente para solucionar casos habituales como:

- Modelación de la incertidumbre a partir de Distribuciones de Probabilidad.
- Evaluar Decisiones de Inversión a partir del VAN y la TIR Bajo Incertidumbre
- Realizar pronósticos de Variables Inciertas
- Optimizar Decisiones de Inversión de Proyectos y Portafolios
- Evaluación de Inversiones a través de Árboles de Decisión

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 y cuantificación de Riesgos.

Objetivo

1. Introducir al participante en Técnicas de Simulación por múltiples escenarios.
2. Analizar e interpretar resultados estadísticos de manera gráfica y numérica.
3. Mostrar al participante la importancia de la Gestión de Riesgos en presencia de Incertidumbre.
4. Entender la simulación de Monte Carlo como metodología para la modelación de incertidumbre en las Decisiones de Inversión.
5. Proporcionar procedimientos para realizar un análisis integrado de riesgos a través del uso de herramientas especializadas como Risk Simulator.

Temario

El Concepto de Riesgo: ¿Qué es y Por qué nos Interesa Conocerlo?

Definición de Riesgo

El Riesgo y las Decisiones Estratégicas

Importancia de la cuantificación de Riesgos

Clasificación de Riesgos

Metodología de Gestión Integral de Riesgos (GIR)

Conceptos de Estadística para la Gestión Cuantitativa de Riesgos

Medidas de Localización

Medidas de Variabilidad

Medidas de Distribución y ubicación relativa

Medidas de Asociación Lineal y no Lineal

Introducción a la Probabilidad

Distribuciones para simular Variables Aleatorias Discretas

Distribuciones para simular Variables Aleatorias Continuas

Intervalos de Confianza

Pruebas de Hipótesis

El Concepto de Riesgo: ¿Qué es y Por qué nos Interesa Conocerlo?

Definición de Riesgo

El Riesgo y las Decisiones Estratégicas

Importancia de la cuantificación de Riesgos

Clasificación de Riesgos

Metodología de Gestión Integral de Riesgos (GIR)

Conceptos de Estadística para la Gestión Cuantitativa de Riesgos

Medidas de Localización

Medidas de Variabilidad

Medidas de Distribución y ubicación relativa

Medidas de Asociación Lineal y no Lineal

Introducción a la Probabilidad

Distribuciones para simular Variables Aleatorias Discretas
Distribuciones para simular Variables Aleatorias Continuas
Intervalos de Confianza
Pruebas de Hipótesis

Modelado de Situaciones para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa de Riesgos

Análisis de Punto único
Análisis de Sensibilidad Estático
Análisis de Simulación de Monte Carlo
Análisis de Sensibilidad Dinámico
Análisis de Escenarios

Tipos de Optimización para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa del Riesgo

Optimización Estática
Optimización Dinámica
Optimización Estocástica

Elaboración de Pronósticos para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa del Riesgo

Componentes y Patrones de una Serie de Tiempo
Desestacionalizar una Serie de Tiempo
Técnicas de Suavizamiento
Metodología Box-Jenkins
Modelo de Regresión Lineal Simple y Múltiple
Modelo de Regresión Logística
Modelos de Volatilidad Condicional

Opciones Reales: Alternativa para la Valoración de Proyectos de Inversión

¿Qué son las Opciones Reales?
Comparación entre Opciones Financieras y Reales
Variables que determinan el Precio de una Opción Real
Metodologías para el Cálculo de la Opción

- Black-Scholes
- Simulación de Monte Carlo
- Árboles Binomiales

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analítica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Información General

Duración

20 Horas

Fecha de Inicio

Lun. 02 de Abr de 2018

Horarios

De:

Abril 2 al 6 de 2018

Hora:

9:00 am a 13:00

Lugar:

Universidad del Pacífico

Ubicación:

Aula Multifuncional J 603

Ciudad

Lima (Lima, Perú)

Lugar:

Universidad del Pacífico

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